

◀資金需給▶

単位 億円

	20日需給速報		21日需給予想	24日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		▲ 900	▲ 1,300	1,000
財政		▲ 28,500	1,900	▲ 6,000
資金過不足		▲ 29,400	600	▲ 5,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)				2,700
66,339				▲ 2,800
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入				
国庫短期証売却				
国債買入			8,300	
CP等買入			3,500	
		▲ 900	▲ 200	
貸出支援基金 (成長) 48,511 (増加) 244,836				
被災地支援				
3,241				
社債等買入				
ETF買入		200		
国債補完供給		▲ 100	100	
小計		▲ 800	11,700	▲ 100
当預増減		▲ 30,200	12,300	▲ 5,100

当座預金残高	2,271,000	8/20以降の残り所要積立額	
準備預金残高	2,061,400		101,400
積み終了先	1,693,500	8/21以降の残り所要積立額	
超過準備	1,685,600	積数	74,100
非準備先残高	209,600	1日平均	2,900
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額(積数)	2,028,500		
準備預金進捗率	96.35% (実績)	16.13% (日数)	

8/19のマネタリーベース		3,256,300	
8/19コール	合計	208,176	無担 77,059 有担 131,117
コール前日増減	計	▲ 5,492	無担 ▲ 4,816 有担 ▲ 676

8/20の加重平均レート(速報)			8/19の加重平均レート(確報)			単位(%)
無担(平均)	有担(平均)	CP気配a-1	短国	無担当日分	無担先日付分	有担当日分
0.060 ~0.125 (0.076)	0.030 ~0.040 (0.031)			0.060 ~0.125 (0.077)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.071 ~0.120 (0.083)					0.074 ~0.120 (0.082)	
0.117 ~0.130 (0.119)				0.117 (0.117)	0.070 ~0.130 (0.102)	
0.200 ~0.280 (0.213)		0.08-0.13	-			有担先日付分
		0.08-0.12	-			
		0.08-0.12	▲0.015-▲0.01			
		-	-			
		-	▲0.085			

◀オペ情報、入札結果▶

全店共通	8,000億円	8/24 ~ 11/24 (92日間)	応札	2,691億円	落札	2,691億円	0.100%	全取	平均	0.100% (固定)
国債補完	8,231億円	8/20 ~ 8/21 (1日間)	応札	60億円	落札	60億円	-0.400%	全取	平均	-0.400% (即)
T-Bill3M	応札20兆1,733億円	落札4兆6,350億4,000万円(非競争入札:4,249億円)	8/24~11/24	▲0.0059%	按分	72.9308%	平均	▲0.0087%		
流動性供給	応札1兆9,305億円	落札4,991億円	8/24	募入最大利回較差	▲0.013%	按分	56.7982%	募入平均利回較差	▲0.020%	
ETF買入	337億円	約定日	8/20							

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入

◀ 8/21の日銀調節とレート予想 ▶					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,283,300	前日比	12,300
O/N	0.07~0.08	T/N	0.07~0.12	S/N	0.07~0.12
無担O/Nは0.07%台半ばでの出合いが中心になると予想される。					

◀ 20日のインターバンク市場動向 ▶
午前8時発表の準備預金残高見込みは、170兆7,000億円(当座預金残高見込みは、227兆1,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.074~0.076%、大手行からは0.074~0.075%の調達希望で始まり、出合いの中心は0.075~0.076%と昨日とほぼ同水準の立ち上がりとなった。昨日同様に一部業態より0.125%で少額の試し取りが行われた。一巡後は0.07%近辺を中心とした少額の出合いで推移し、本日の取引を終えた。ターム物は、大手行から1W0.117%で調達が行われた。3M物の共通担保オペが8,000億円オファーされ、応札額2,691億円(期落ち分2,840億円)と札割れの結果となった。

◀ 20日のオープン市場動向 ▶
現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は、3M物入札が行われた。W I取引で、▲0.008~▲0.006%の水準で出合いが見られたこともあり、平均落札利回▲0.0087%、按分落札利回▲0.0059%の強めの決着となった。セカンダリーでは、▲0.015~▲0.01%と更に買い進まれた。CP市場は、800億円程度の償還に対し、機械業態からの大型発行案件が実施され、1,000億円程度の発行となった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

◀ 21日の材料 ▶
*特にありません

JGB新発10年債	0.355	▲ 0.015	日経平均株価(終値)	20,033.52	▲ 189.11	為替(9時)	123.92-94
						為替(5時)	124.03-05

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	8/13	8/14	8/17	8/18	8/19	8/20
日銀当預残	2,221,100	2,297,000	2,264,400	2,297,900	2,301,200	2,271,000
準備預金残	2,025,200	2,093,800	2,062,600	2,093,500	2,093,500	2,061,400
レート	0.075%	0.076%	0.077%	0.083%	0.077%	0.076%
月中平均	0.07408%	0.07444%	0.07459%	0.07506%	0.07516%	0.07520%