

Central Daily Market Report

2024年8月13日（火）
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2024年8月13日 需給速報	2024年8月14日 需給予想	2024年8月15日 当社予想			
銀行券	100	500	1,000			
財政	5,700	1,100	57,000			
資金過不足	5,800	1,600	58,000			
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 20,800	19,000		20,800		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	3,900		22,200		58,000	
当座預金残高	5,424,800		5,447,000		5,505,000	
準備預金残高	4,840,500					
積み終了先	4,840,400		8月14日以降の残り所要積立額 積数 0 1日平均 0			
超過準備	4,840,400					
非準備預金先	584,300					
積み期間（7/16～8/15）の所要準備額					4,075,700	
準備預金進捗率	実績 100.00%		日数		93.55%	

●2024年8月13日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担保コールO/N物は、積み最終週に入ったが、市場に大きな変化は見られず、引き続き邦銀業態を中心に堅調な資金調達ニーズが見られたことで、出合いの水準は0.225～0.228%程度で推移した。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.21～0.235%程度での出合いとなった。
SCは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

＜短国市場＞

13日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数の業態で入札が実施された。発行レートは0.25%以上で推移し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

2024/8/13	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	0.215	0.229	0.227				－	0.229
T/N							－	0.224
S/N							－	－
1W			0.228				－	0.177
2W			0.330				－	0.176
3W							－	0.177
1M							－	0.179
3M			0.600				0.090	0.200
6M							0.129	0.252
1Y							0.189	0.317

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.840	▲ 0.015	36,232.51	+1,207.51	147.02-05	147.83-85
日付	8/5	8/6	8/7	8/8	8/9
日銀当預残	5,432,400	5,444,200	5,423,100	5,428,400	5,420,900
準備預金残	4,851,500	4,864,000	4,845,500	4,853,100	4,836,300
マネタリーベース	6,677,900	6,689,300	6,668,000	6,673,800	6,666,700
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	117,372	119,549	121,681	115,016	114,561
うち無担	82,594	83,441	85,190	78,713	77,967
うちO/N	38,807	38,824	40,403	33,566	33,430
うち有担	34,778	36,108	36,491	36,303	36,594

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額 （億円）	募入額 （億円）	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札 （億円）
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額 （億円・ 百万ドル）	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額 （億円・ 百万ドル）	落札総額 （億円・ 百万ドル）	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分比率
米ドル資金供給		2024/8/15	2024/8/22	5.580	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/8/13	2024/8/14	▲ 0.050	21,152	21,152		▲ 0.050	▲ 0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/8/13	2024/8/14	▲ 0.050	40	40		▲ 0.050	▲ 0.050	

●2024年8月14日の予定

*7月の米消費者物価指数 *4-6月期のユーロ圏GDP2次速報 *7月の英消費者物価指数	*5年利付国債入札 (23,000億円、8/15発行)
--	--------------------------------

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。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ことがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録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