

Central Daily Market Report

2024年8月14日(水)

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14日 需給速報	2024年8月15日 需給予想	2024年8月16日 当社予想
銀行券	500	200	800
財政	▲ 1,600	54,700	1,000
資金過不足	▲ 1,100	54,900	1,800

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	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		▲ 200		▲ 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	▲ 18,300	20,800		18,300				
当預増減	1,200		73,000				1,800	

当座預金残高	5,426,000	5,499,000	5,500,800	
準備預金残高	4,848,300			
積み終了先	4,848,300			
超過準備	4,848,200			
非準備預金先	577,700			
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	96.77%

●2024年8月14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、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、0.21~0.25%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>

14日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<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

2024/8/14	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	0.218	0.290	0.228				-	0.224
T/N							-	0.230
S/N							-	-
1W	0.228	0.390	0.233				-	0.180
2W	0.320	0.330	0.323				-	0.181
3W							-	0.179
1M							-	0.180
3M			0.350				0.120	0.200
6M							0.130	0.252
1Y							0.190	0.315

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)
0.805	▲ 0.035	36,442.43	+209.92	146.94~97	147.40~42
日付	8/6	8/7	8/8	8/9	8/13
日銀当預残	5,444,200	5,423,100	5,428,400	5,420,900	5,424,800
準備預金残	4,864,000	4,845,500	4,853,100	4,836,300	4,840,000
マネタリーベース	6,689,300	6,668,000	6,673,800	6,666,700	6,670,500
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	119,549	121,681	115,016	114,561	114,804
うち無担	83,441	85,190	78,713	77,967	77,897
うちO/N	38,824	40,403	33,566	33,430	33,160
うち有担	36,108	36,491	36,303	36,594	36,907

●入札結果

名称	回数	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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償額募入札(億円)	非償募入札(億円)
5年利付国債	171	0.4%	23,000	2024/8/15	2029/6/20	61,314	17,464	99.70	0.463%	27.4954%	99.75	0.452%	5,531	0.1

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/14	2024/8/15	▲0.050	18,686	18,686		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/14	2024/8/15	▲0.050	0	0				

●2024年8月15日の予定

*4-6月期のGDP 1次速報 (市場予想:前期比年率+2.3%)	*7月の米小売売上高 *7月の米鉱工業生産・設備稼働率 *6月の米企業在庫 *4-6月期の英GDP速報値	*国有林野借入 (961億円、8/26借入)
--------------------------------------	---	---------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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場合があります。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