

●資金需給

単位：億円	2024年8月15日 需給速報	2024年8月16日 需給予想	2024年8月19日 当社予想	
銀行券	200	700	1,000	
財政	56,400	▲ 400	6,500	
資金過不足	56,600	300	7,500	
金融調節	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		9,700		
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			300	▲ 400
社債等買入				
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 17,500	18,300	17,500	
※ドル資金供給用担保提供供給				
当預増減	57,200	27,300	7,400	
当座預金残高	5,483,200	5,510,500	5,517,900	
準備預金残高	4,918,600			
積み終了先	4,918,600		8月16日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,918,600		積数	4,070,500
非準備預金先	564,600		1日平均	131,300
積み期間(8/16～9/15)の所要準備額				4,070,500
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%

●短期金融市場関連指標

2024/8/15	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	0.220	0.228	0.227				-	0.238
T/N							-	0.227
S/N							-	-
1W							-	0.185
2W	0.281	0.400	0.313				-	0.182
3W							-	0.180
1M			0.290				-	0.181
3M			0.335				0.120	0.200
6M							0.100	0.252
1Y							0.190	0.314

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)
0.834	+0.029	36,726.64	+284.21	147.27-29	147.21-23
日付	8/7	8/8	8/9	8/13	8/14
日銀当預残	5,423,100	5,428,400	5,420,900	5,424,800	5,426,000
準備預金残	4,845,500	4,853,100	4,836,300	4,840,000	4,848,300
マネタリーベース	6,668,000	6,673,800	6,666,700	6,670,500	6,671,200
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%
コール市場残高	121,681	115,016	114,561	114,804	112,111
うち無担	85,190	78,713	77,967	77,897	75,597
うちO/N	40,403	33,566	33,430	33,160	32,380
うち有担	36,491	36,303	36,594	36,907	36,514

●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・利 回較差	案分率	募入 平均価格	募入平均利回・利 回較差	第I非価格 競争入札(億円)
国有林野借入	-	-	961	2024/8/26	2029/8/25	3,934	961		0.520%	40.3334%		0.493%	

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2024/8/16			14,426	3,505	0.002		0.003	76.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2024/8/16			12,150	4,006	0.007		0.008	26.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/8/16			4,149	1,509	0.006		0.007	85.7
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/8/16			1,871	751	0.009		0.011	40.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2024/8/15	2024/8/16	▲0.050	17,841	17,841		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2024/8/15	2024/8/16	▲0.050	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
被災地金融支援オペ	第25回 2024/8/19	2025/8/18	0.25%	279

●2024年8月16日の予定

*6月の第3次産業活動指数	*7月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1250回)入札 (3ヶ月、49,000億円、8/19発行)	*10年物価連動国債 (2,500億円、8/19発行)
*6月の石油等消費動態統計	*8月のミシガン大消費者信頼感指数速報		

◆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

●2024年8月15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、積み最終日を迎えたが、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0.226~0.228%程度で推移した。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.22~0.24%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＞

15日のアウトラ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。