

Central Daily Market Report

2024年8月16日(金)

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16日 需給速報	2024年8月19日 需給予想	2024年8月20日 当社予想
銀行券	800	500	500
財政	1,100	4,800	3,500
資金過不足	1,900	5,300	4,000

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	9,700					
CP等買入		▲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	▲18,300	17,500		18,300		
当預増減	10,600		23,500		4,000	

当座預金残高	5,493,800	5,517,300	5,521,300	
準備預金残高	4,931,100			
積み終了先	4,909,000			
超過準備	3,585,900			
非準備預金先	562,700			
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	99.14%	日数	9.68%

●2024年8月16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、積み初日を迎えたが、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、出合いの水準に大きな変化は見られず0.226~0.228%程度で推移した。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.23~0.24%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>

16日はTB3M物(第1250回)の入札が実施され、予想よりも強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、強含みで推移した。この他、6M物でも出合いが見られた。

<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

2024/8/16	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	売買参考統計値	平均値
O/N	0.218	0.228	0.227				-	0.233
T/N							-	0.230
S/N							-	-
1W			0.275				-	0.186
2W							-	0.184
3W							-	0.183
1M	0.290	0.320	0.297				-	0.184
3M			0.350				0.110	0.201
6M							0.120	0.253
1Y							0.210	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)
0.870	+0.036	38,062.67	+1,336.03	149.23-25	149.03-05
日付	8/8	8/9	8/13	8/14	8/15
日銀当預残	5,428,400	5,420,900	5,424,800	5,426,000	5,483,200
準備預金残	4,853,100	4,836,300	4,840,000	4,848,300	4,918,600
マネタリーベース	6,673,800	6,666,700	6,670,500	6,671,200	6,728,100
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%	0.227%
コール市場残高	115,016	114,561	114,804	112,111	110,394
うち無担	78,713	77,967	77,897	75,597	73,220
うちO/N	33,566	33,430	33,160	32,380	30,833
うち有担	36,303	36,594	36,907	36,514	37,174

●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)
国庫短期証券	1250	-	49,000	2024/8/19	2024/11/18	129,100	37,261.6	99,9705	0.1183%	89.6119%	99.9721	0.1119%	11,738
物価連動10年	29	0.005%	2,500	2024/8/19	2034/3/10	7,385	2,499	104.30	▲0.426%	53.3333%			

●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
社債等買入	500	2024/8/21			1,264	500	0.576		0.613	44.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/16	2024/8/19	▲0.050	18,624	18,624		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/16	2024/8/19	▲0.050	1	1		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月19日の予定

*6月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+1.1%)	*国庫短期証券(1251回)入札 (1年、32,000億円、8/20発行)
---	--

◆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