

●資金需給

単位：億円	2024年8月20日 需給速報		2024年8月21日 需給予想		2024年8月22日 当社予想	
銀行券	500		▲ 100		▲ 500	
財政	1,800		▲ 15,300		1,500	
資金過不足	2,300		▲ 15,400		1,000	
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			8,000	▲ 8,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			500			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 18,700	18,000		18,700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	1,600		3,800		1,000	
当座預金残高	5,496,500		5,500,300		5,501,300	
準備預金残高	4,932,800					
積み終了先	4,927,700		8月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,927,600		積数 17,800			
非準備預金先	563,700		1日平均 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 99.56%		日数 16.13%			

●短期金融市場関連指標

2024/8/20	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				－	0.242
T/N							－	0.240
S/N							－	－
1W			0.227				－	0.190
2W							－	0.188
3W							－	0.187
1M							－	0.188
3M			0.350				0.110	0.204
6M							0.140	0.254
1Y							0.240	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)
0.885	0.000	38,062.92	+674.30	146.71-73	146.55-57

日付	8/13	8/14	8/15	8/16	8/19
日銀当預残	5,424,800	5,426,000	5,483,200	5,493,800	5,494,900
準備預金残	4,840,000	4,848,300	4,918,600	4,931,100	4,923,700
マネタリーベース	6,670,500	6,671,200	6,728,100	6,738,000	6,738,700
無担O/N加重平均	0.227%	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	114,804	112,111	110,394	109,511	111,564
うち無担	77,897	75,597	73,220	71,791	74,665
うちO/N	33,160	32,380	30,833	30,614	33,018
うち有担	36,907	36,514	37,174	37,720	36,899

●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)
20年利付国債	189	1.9%	10,000	2024/8/21	2044/6/20	26,023	7,604	102.70	1.717%	27.6008%	102.87	1.706%	2,389

●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		2024/8/22	2024/8/29	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/20	2024/8/21	▲0.050	17,801	17,801		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	8,000	2024/8/21	2024/9/4	0.250	8,877	8,006				90.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/20	2024/8/21	▲0.050	1,299	1,299		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月21日の予定

*7月の貿易統計

◆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

●2024年8月20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、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事から、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、0.225～0.250%程度での出合いとなった。
SCI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＞

20日のアウトライ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、複数の業態で大型発行が実施された。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。