

Central Daily Market Report

2024年8月21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21日 需給速報	2024年8月22日 需給予想	2024年8月23日 当社予想
銀行券	▲ 200	▲ 200	▲ 500
財政	▲ 19,900	17,000	▲ 6,000
資金過不足	▲ 20,100	16,800	▲ 6,500

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			11,200			
CP等買入				▲ 600		
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	▲ 15,500	18,700		15,500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 16,400		42,900		▲ 6,500	

当座預金残高	5,480,100	5,523,000	5,516,500	
準備預金残高	4,917,700			
積み終了先	4,912,700			
超過準備	4,912,300			
非準備預金先	562,400			
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	99.69%	日数	19.35%

●2024年8月21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ことから、出会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、0.225~0.245%程度での出会いとなった。
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>

21日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<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。

●短期金融市場関連指標

2024/8/21	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	売買参考値 平均値
O/N	0.215	0.228	0.227				-	0.238
T/N							-	0.239
S/N							-	-
1W				0.240			-	0.192
2W	0.228	0.310	0.231				-	0.189
3W							-	0.189
1M							-	0.189
3M							0.110	0.203
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)
0.865	▲ 0.020	37,951.80	▲ 111.12	145.32-34	146.14-16
日付	8/14	8/15	8/16	8/19	8/20
日銀当預残	5,426,000	5,483,200	5,493,800	5,494,900	5,496,500
準備預金残	4,848,300	4,918,600	4,931,100	4,923,700	4,932,800
マネタリーベース	6,671,200	6,728,100	6,738,000	6,738,700	6,739,800
無担O/N加重平均	0.228%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	112,111	110,394	109,511	111,564	112,972
うち無担	75,597	73,220	71,791	74,665	74,505
うちO/N	32,380	30,833	30,614	33,018	32,748
うち有担	36,514	37,174	37,720	36,899	38,467

●入札結果

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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2024/8/22			11,189	3,509	▲0.013		▲0.011	44.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,750	2024/8/22			9,319	3,758	▲0.023		▲0.022	92.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2024/8/22			11,967	4,006	▲0.015		▲0.013	47.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/21	2024/8/22	▲0.050	15,761	15,761		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/21	2024/8/22	▲0.050	0	0				

●2024年8月22日の予定

*7月の米中古住宅販売件数
*ジャクソンホール会議(24日まで)

*流動性供給入札
(6,500億円、8/23発行)
*交付税特別会計借入
(12,500億円、8/30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