

Central Daily Market Report

2024年8月22日(木)
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22日 需給速報		2024年8月23日 需給予想		2024年8月26日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 400		500	
財政	15,900		▲ 5,400		15,000	
資金過不足	15,700		▲ 5,800		15,500	
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						
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		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 15,200	15,500		15,200		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	26,600		8,500		15,500	
当座預金残高	5,506,700		5,515,200		5,530,700	
準備預金残高	4,940,900		8月23日以降の残り所要積立額 積数 10,100 1日平均 400			
積み終了先	4,939,600					
超過準備	4,938,500					
非準備預金先	565,800					
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 99.75%		日数		22.58%	

●2024年8月22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、0.150~0.23%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＞

22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、一部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

2024/8/22	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	0.211	0.228	0.227				-	0.232
T/N							-	0.229
S/N							-	-
1W			0.390				-	0.196
2W							-	0.193
3W							-	0.191
1M			0.310				-	0.191
3M	0.310	0.350	0.323				0.110	0.204
6M							0.120	0.254
1Y							0.240	0.318

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	+0.005	38,211.01	+259.21	145.12-14	145.26-28

日付	8/15	8/16	8/19	8/20	8/21
日銀当預残	5,483,200	5,493,800	5,494,900	5,496,500	5,480,100
準備預金残	4,918,600	4,931,100	4,923,700	4,932,800	4,917,700
マネタリーベース	6,728,100	6,738,000	6,738,700	6,739,800	6,723,600
無担〇/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	110,394	109,511	111,564	112,972	114,173
うち無担	73,220	71,791	74,665	74,505	76,732
うち〇/N	30,833	30,614	33,018	32,748	35,095
うち有担	37,174	37,720	36,899	38,467	37,441

●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1非償 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億円)
流動性供給	411	-	6,500	2024/8/23	-	19,781	6,496		▲0.002%	32.3389%		▲0.005%		
交付税特会	-	-	12,500	2024/8/30	2025/2/28	69,266	12,490		0.280%	84.9145%		0.269%		10

●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)		2024/8/22	2024/8/23	▲0.050	15,484	15,484		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/22	2024/8/23	▲0.050	35	35		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月23日の予定

*7月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.7%)	*7月の米新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(1252回)入札 (3ヶ月、49,000億円、8/26発行)
---	-----------------	---

◆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