

Central Daily Market Report

2024年8月23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23日 需給速報		2024年8月26日 需給予想		2024年8月27日 当社予想	
銀行券	▲ 600		100		1,000	
財政	200		7,100		1,000	
資金過不足	▲ 400		7,200		2,000	
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						
CP等買入		▲ 800		▲ 100		
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	▲ 15,300	15,200		15,300		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 1,400		22,400		2,000	
当座預金残高	5,505,300		5,527,700		5,529,700	
準備預金残高	4,929,000					
積み終了先	4,927,900		8月26日以降の残り所要積立額 積数 6,500 1日平均 300			
超過準備	4,927,800					
非準備預金先	576,300					
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 99.84%		日数 32.26%			

●2024年8月23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、0.165～0.25%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＞

23日はTB3M物（第1252回）の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。この他、1Y物でも出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2024/8/23	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	0.215	0.228	0.227				－	0.142
T/N							－	0.227
S/N							－	－
1W			0.268				－	0.193
2W			0.300				－	0.193
3W							－	0.191
1M							－	0.191
3M	0.290	0.330	0.328				0.050	0.203
6M							0.100	0.253
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)
0.890	+0.020	38,364.27	+153.26	146.21-23	145.81-83

日付	8/16	8/19	8/20	8/21	8/22
日銀当預残	5,493,800	5,494,900	5,496,500	5,480,100	5,506,700
準備預金残	4,931,100	4,923,700	4,932,800	4,917,700	4,940,900
マネタリーベース	6,738,000	6,738,700	6,739,800	6,723,600	6,750,400
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	109,511	111,564	112,972	114,173	113,587
うち無担	71,791	74,665	74,505	76,732	75,956
うちO/N	30,614	33,018	32,748	35,095	34,529
うち有担	37,720	36,899	38,467	37,441	37,631

●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非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	1252	－	49,000	2024/8/26	2024/11/25	128,855	37,199.5	99.9740	0.1043%	33.1987%	99.9757	0.0974%	11,800

●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）		2024/8/23	2024/8/26	▲0.050	15,599	15,599		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/8/23	2024/8/26	▲0.050	0	0				

●2024年8月26日の予定

*6月の景気動向指数改訂状況	*7月の米耐久財新規受注 *London祝日（SummerBankHoliday）
----------------	--

◆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