

●資金需給

単位：億円	2024年8月26日 需給速報		2024年8月27日 需給予想		2024年8月28日 当社予想					
銀行券	0		0		▲ 300					
財政	100		7,000		▲ 5,000					
資金過不足	100		7,000		▲ 5,300					
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		▲ 100		▲ 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										
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 14,800	15,300		14,800						
※ドル資金供給用国債国債供給										
当預増減	500		21,700		▲ 5,300					
当座預金残高	5,505,800		5,527,500		5,522,200					
準備預金残高	4,941,300		8月27日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>5,300</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>300</td></tr></table>				積数	5,300	1日平均	300
積数	5,300									
1日平均	300									
積み終了先	4,940,100									
超過準備	4,940,100									
非準備預金先	564,500									
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	99.87%	日数	35.48%						

●2024年8月26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、週末要因が剥落したものの出会いの水準に大きな変化は見られず、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズから、0.226～0.228%程度で推移した。
ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

＜レボ市場＞
GC T/Nは、0.19～0.245%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＞
26日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で出会いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は数件の入札が実施された。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

2024/8/26	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京 レボレート
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	0.229	0.227				－	0.239
T/N							－	0.214
S/N							－	－
1W							－	0.193
2W							－	0.193
3W							－	0.190
1M			0.300				－	0.190
3M							0.050	0.204
6M							0.100	0.253
1Y							0.240	0.316

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)
0.879	▲ 0.011	38,110.22	▲ 254.05	143.92-95	143.89-92

日付	8/19	8/20	8/21	8/22	8/23
日銀当預残	5,494,900	5,496,500	5,480,100	5,506,700	5,505,300
準備預金残	4,923,700	4,932,800	4,917,700	4,940,900	4,929,500
マネタリーベース	6,738,700	6,739,800	6,723,600	6,750,400	6,749,500
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	111,564	112,972	114,173	113,587	115,122
うち無担	74,665	74,505	76,732	75,956	77,944
うちO/N	33,018	32,748	35,095	34,529	36,697
うち有担	36,899	38,467	37,441	37,631	37,178

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札 （億円）
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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/8/26	2024/8/27	▲0.050	15,172	15,172		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/8/26	2024/8/27	▲0.050	3	3		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月27日の予定

*7月の企業向けサービス価格指数	*6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 *8月の米CB消費者信頼感指数	*流動性供給入札 （4,000億円、8/28発行） *交付税特別会計借入 （12,500億円、9/4借入）
------------------	--	--

◆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