

# Central Daily Market Report

2024年8月27日(火)

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27日 需給速報	2024年8月28日 需給予想	2024年8月29日 当社予想			
銀行券	▲ 100	0	▲ 500			
財政	▲ 800	▲ 7,200	1,000			
資金過不足	▲ 900	▲ 7,200	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						
CP等買入		▲ 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	▲ 16,200	14,800		16,200		
当預増減	▲ 2,400		9,000			500
当座預金残高	5,503,400		5,512,400			5,512,900
準備預金残高	4,937,600					
積み終了先	4,936,200				8月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,936,200				積数	3,900
非準備預金先	565,800				1日平均	200
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	99.90%	日数	38.71%		

## ●2024年8月27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、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。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.205~0.25%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>

27日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は複数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。  
本日CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.299%、平均レート0.344%と利上げ前の前回(全取0.226%、平均0.246%)比で、按分レート、平均レート共に大幅に上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2024/8/27	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート
	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	0.290	0.227				-	0.242
T/N							-	0.221
S/N							-	-
1W			0.227				-	0.193
2W	0.310	0.320	0.318				-	0.193
3W							-	0.191
1M			0.300				-	0.189
3M							0.060	0.203
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)
0.875	▲ 0.004	38,288.62	+178.40	144.50-52	144.98-00
日付	8/20	8/21	8/22	8/23	8/26
日銀当預残	5,496,500	5,480,100	5,506,700	5,505,300	5,505,800
準備預金残	4,932,800	4,917,700	4,940,900	4,929,500	4,940,300
マネタリーベース	6,739,800	6,723,600	6,750,400	6,749,500	6,750,000
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	112,972	114,173	113,587	115,122	114,109
うち無担	74,505	76,732	75,956	77,944	74,298
うちO/N	32,748	35,095	34,529	36,697	33,041
うち有担	38,467	37,441	37,631	37,178	39,811

## ●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)	非競争入札(億円)
流動性供給	412	-	4,000	2024/8/28	-	12,335	3,984		▲0.005%	57.6363%		▲0.007%		
交付税特会	-	-	12,500	2024/9/4	2025/3/4	70,403	12,490		0.275%	47.5545%		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
米ドル資金供給		2024/8/29	2024/9/5	5.580	1	1				
CP等買入	4,000	2024/8/30			8,685	4,000	0.299		0.344	60.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/27	2024/8/28	▲0.050	16,611	16,611		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/27	2024/8/28	▲0.050	1	1		▲0.050	▲0.050	

## ●2024年8月28日の予定

\*特にありません

◆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