

Central Daily Market Report

2024年8月28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28日 需給速報	2024年8月29日 需給予想	2024年8月30日 当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 200	800
財政	▲ 6,600	▲ 2,400	4,500
資金過不足	▲ 6,700	▲ 2,600	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			10,400			
CP等買入				▲ 200	4,000	
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						
国債補充供給	▲ 15,700	16,200		15,700		
当預増減	▲ 6,200		23,300		9,300	

当座預金残高	5,497,200	5,520,500	5,529,800	
準備預金残高	4,937,000			
積み終了先	4,935,900			
超過準備	4,935,900			
非準備預金先	560,200			
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	99.93%	日数	41.94%

●2024年8月28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、出合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、0.165~0.215%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>

28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、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

2024/8/28	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	売買参考値	平均値
O/N	0.215	0.229	0.227				-	0.243
T/N							-	0.196
S/N							-	-
1W							-	0.182
2W			0.310				-	0.184
3W			0.275				-	0.186
1M							-	0.186
3M			0.350				0.064	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)
0.890	+0.015	38,371.76	+83.14	143.94-97	144.55-58

日付	8/21	8/22	8/23	8/26	8/27
日銀当預残	5,480,100	5,506,700	5,505,300	5,505,800	5,503,400
準備預金残	4,917,700	4,940,900	4,929,500	4,940,300	4,937,600
マネタリーベース	6,723,600	6,750,400	6,749,500	6,750,000	6,747,700
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	114,173	113,587	115,122	114,109	115,504
うち無担	76,732	75,956	77,944	74,298	77,326
うちO/N	35,095	34,529	36,697	33,041	35,649
うち有担	37,441	37,631	37,178	39,811	38,178

●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3年超5年以下)	3,750	2024/8/29			9,064	3,755	0.006		0.006	89.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,000	2024/8/29			11,550	4,008	0.013		0.014	50.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/8/29			3,982	1,503	0.016		0.016	95.9
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/8/29			2,218	752	0.015		0.017	67.1
国債買入(物価連動債)	600	2024/8/29			2,535	600	▲0.380		▲0.413	72.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/28	2024/8/29	▲0.050	16,013	16,013		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/28	2024/8/29	▲0.050	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特則第37期(借り換え)	2024/9/5	2025/9/5	1,661	17

●2024年8月29日の予定

*月例経済報告 *8月の消費動向調査	*4-6月期の米GDP改定値	*2年利付国債入札 (26,000億円、9/2発行)	*交付税特別会計借入 (11,950億円、9/9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