

Central Daily Market Report

2024年8月29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29日 需給速報	2024年8月30日 需給予想	2024年9月2日 当社予想
銀行券	▲ 300	400	700
財政	▲ 8,100	▲ 200	▲ 8,000
資金過不足	▲ 8,400	200	▲ 7,300

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	▲ 700		
貸出支援基金(成)						▲ 1,800
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						
国債補充供給	▲ 16,100	15,700		16,100		
※ F T F 資金供給用国債提供枠						
当預増減	1,400		19,500		▲ 9,100	

当座預金残高	5,498,600	5,518,100	5,509,000	
準備預金残高	4,928,600			
積み終了先	4,927,700			
超過準備	4,927,700			
非準備預金先	570,000			
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	99.96%	日数	45.16%

●2024年8月29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、0.05~0.205%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>

29日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の発行が実施された。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

2024/8/29	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	0.220	0.275	0.228					-	0.204
T/N								-	0.058
S/N								-	-
1W								-	0.163
2W								-	0.170
3W								-	0.174
1M								-	0.173
3M								0.110	0.201
6M								0.100	0.252
1Y								0.235	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)
0.885	▲ 0.005	38,362.53	▲ 9.23	144.44-46	144.71-73
日付	8/22	8/23	8/26	8/27	8/28
日銀当預残	5,506,700	5,505,300	5,505,800	5,503,400	5,497,200
準備預金残	4,940,900	4,929,500	4,940,300	4,937,600	4,937,000
マネタリーベース	6,750,400	6,749,500	6,750,000	6,747,700	6,741,500
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	113,587	115,122	114,109	115,504	115,030
うち無担	75,956	77,944	74,298	77,326	76,575
うちO/N	34,529	36,697	33,041	35,649	33,708
うち有担	37,631	37,178	39,811	38,178	38,455

●入札結果

名称	回数	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)
2年利付国債	464	0.4%	26,000	2024/9/2	2026/9/1	108,075	19,500	100.025	0.387%	82.2855%	100.028	0.385%	6,486	10.45
交付税特会	-	-	11,950	2024/9/9	2025/3/11	67,488	11,940		0.270%	12.1967%		0.265%		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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/29	2024/8/30	▲0.050	15,960	15,960		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/29	2024/8/30	▲0.050	429	429		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月30日の予定

*8月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.2%)	*7月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1253回)入札 (3ヶ月、49,000億円、9/2発行)
*7月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*8月のシカゴPM景況感指数	
*7月の有効求人倍率(市場予想:1.23倍)	*8月のユーロ圏消費者物価指数速報値	
*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+3.3%)		
*7月の商業動態統計速報		
*7月の住宅着工統計		

◆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論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