

Central Daily Market Report

2024年8月30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30日 需給速報	2024年9月2日 需給予想	2024年9月3日 当社予想			
銀行券	400	600	600			
財政	2,100	▲ 16,900	▲ 11,000			
資金過不足	2,500	▲ 16,300	▲ 10,400			
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	4,000	▲ 700				
貸出支援基金(成)				▲ 1,500		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 300		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 16,000	16,100		16,000		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	5,800	▲ 2,100		▲ 10,400		
当座預金残高	5,504,400	5,502,300		5,491,900		
準備預金残高	4,911,400					
積み終了先	4,911,300				9月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,911,100				積数	800
非準備預金先	593,000				1日平均	100
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	99.98%	日数	54.84%		

●2024年8月30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、月末のため一部調達を見合わせる先が見られたものの、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、0.18~0.25%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>

30日はTB3M物(第1253回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<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

2024/8/30	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	0.218	0.229	0.227				-	0.173
T/N							-	0.230
S/N							-	-
1W				0.390			-	0.187
2W	0.300	0.400	0.320				-	0.187
3W							-	0.185
1M							-	0.185
3M							0.090	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)
0.890	+0.005	38,647.75	+285.22	144.88-91	144.93-94
日付	8/23	8/26	8/27	8/28	8/29
日銀当預残	5,505,300	5,505,800	5,503,400	5,497,200	5,498,600
準備預金残	4,929,500	4,940,300	4,937,600	4,937,000	4,928,700
マネタリーベース	6,749,500	6,750,000	6,747,700	6,741,500	6,743,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%
コール市場残高	115,122	114,109	115,504	115,030	117,428
うち無担	77,944	74,298	77,326	76,575	79,880
うちO/N	36,697	33,041	35,649	33,708	36,523
うち有担	37,178	39,811	38,178	38,455	37,548

●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I非償格競争入札(億円)
国庫短期証券	1253	-	49,000	2024/9/2	2024/12/2	132,790	37,182.8	99.9745	0.1023%	58.1989%	99.9764	0.0946%	11,817

●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)		2024/8/30	2024/9/2	▲0.150	16,167	16,167		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/30	2024/9/2	▲0.150	201	201		▲0.150	▲0.150	

●2024年9月2日の予定

*4-6月期の法人企業統計調査季報

*New York祝日(Labor Day)

◆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