

Central Daily Market Report

2024年8月19日(月)

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19日 需給速報	2024年8月20日 需給予想	2024年8月21日 当社予想
銀行券	400	400	▲ 500
財政	500	5,500	▲ 16,000
資金過不足	900	5,900	▲ 16,500

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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援	300	▲ 400				
社債等買入					500	
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 18,000	18,300		18,000		
当預増減	1,100		23,900		▲ 24,000	

当座預金残高	5,494,900	5,518,800	5,494,800	
準備預金残高	4,923,600			
積み終了先	4,918,300		8月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,911,700		積数	23,100
非準備預金先	571,300		1日平均	900
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	99.43%	日数	12.90%

●短期金融市場関連指標

2024/8/19	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	0.220	0.228	0.227				-	0.224
T/N							-	0.223
S/N							-	-
1W	0.228	0.275	0.244				-	0.188
2W							-	0.186
3W							-	0.184
1M							-	0.185
3M			0.350				0.110	0.202
6M							0.140	0.253
1Y							0.245	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	+0.015	37,388.62	▲ 674.05	147.96-98	146.08-10
日付	8/9	8/13	8/14	8/15	8/16
日銀当預残	5,420,900	5,424,800	5,426,000	5,483,200	5,493,800
準備預金残	4,836,300	4,840,000	4,848,300	4,918,600	4,931,100
マネタリーベース	6,666,700	6,670,500	6,671,200	6,728,100	6,738,000
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.228%	0.227%	0.227%
コール市場残高	114,561	114,804	112,111	110,394	109,511
うち無担	77,967	77,897	75,597	73,220	71,791
うちO/N	33,430	33,160	32,380	30,833	30,614
うち有担	36,594	36,907	36,514	37,174	37,720

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1251	-	32,000	2024/8/20	2025/8/20	74,817	24,327	99.747	0.2536%	14.0000%	99.775	0.2255%	7,673

●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)		2024/8/19	2024/8/20	▲0.050	18,232	18,232		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/19	2024/8/20	▲0.050	207	207		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月20日の予定

*7月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*20年利付国債入札(10,000億円、8/21発行)
--------------------	-----------------------------

◆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

●2024年8月19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、引き続き邦銀業態を中心に堅調な資金調達ニーズが見られたことから、出会いの水準に大きな変化は見られず、0.226~0.228%程度で推移した。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.220~0.255%程度での出会いとなった。
SC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>

19日は、TDB1Y物(第1251回)の入札が実施され、テールが流れる結果となったが、結果発表後のセカンダリーでは、小じつかりと推移した。このほか6M物でも出会いが見られた。

<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。