

●資金需給

単位：億円	2024年8月1日 需給速報		2024年8月2日 需給予想		2024年8月5日 当社予想	
銀行券	100		200		500	
財政	2,500		▲ 59,900		6,000	
資金過不足	2,600		▲ 59,700		6,500	
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				▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 29,200	23,200		29,200		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 3,400		▲ 30,700		6,500	
当座預金残高	5,481,400		5,450,700		5,457,200	
準備預金残高	4,913,200					
積み終了先	4,913,100		8月2日以降の残り所要積立額 積数 700 1日平均 100			
超過準備	4,913,100					
非準備預金先	568,200					
積み期間（7/16～8/15）の所要準備額					4,082,100	
準備預金進捗率	実績 99.98%		日数		54.84%	

●2024年8月1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物は政策変更に伴いレートは上昇しており、水準は0.225~0.228%程度で出合った。主な参加者に変化は見られなかった。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.18~0.23%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＞
1日のアウトライト市場では、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞
CP発行市場は、数件の入札が実施された。発行レートは利上げの影響から0.25%以上で推移し、銘柄によって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

2024/8/1	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	0.215	0.228	0.227				-	0.166
T/N							-	0.200
S/N							-	-
1W	0.228	0.325	0.234				-	0.186
2W	0.280	0.330	0.317				-	0.186
3W							-	0.187
1M	0.300	0.430	0.337				-	0.189
3M							0.150	0.202
6M							0.150	0.244
1Y							0.275	0.317

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)
1.030	▲ 0.025	38,126.33	▲ 975.49	149.78-80	149.85-87

日付	7/25	7/26	7/29	7/30	7/31
日銀当預残	5,469,100	5,479,900	5,480,300	5,495,100	5,484,800
準備預金残	4,883,200	4,884,600	4,901,700	4,899,000	4,896,500
マネタリーベース	6,715,000	6,725,900	6,726,200	6,741,400	6,731,200
無担O/N加重平均	0.081%	0.078%	0.077%	0.077%	0.079%
コール市場残高	115,193	110,415	113,834	111,319	111,823
うち無担	78,049	74,593	77,626	75,242	76,621
うちO/N	32,827	29,381	32,694	30,310	33,926
うち有担	37,144	35,822	36,208	36,077	35,202

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/1	2024/8/2	▲0.150	30,046	30,046		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/1	2024/8/2	▲0.150	106	106		▲0.150	▲0.150	

●2024年8月2日の予定

*7月のマネタリーベース	*7月の米雇用統計	*国庫短期証券(1247回)入札
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*6月の米製造業新規受注・出荷・在庫	(3ヶ月、52,000億円、8/5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