

# Central Daily Market Report

2024年8月2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2日<br>需給速報 |        | 2024年8月5日<br>需給予想                                                                                         |        | 2024年8月6日<br>当社予想 |     |    |     |      |   |
|-----------------------|-------------------|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-------------------|-----|----|-----|------|---|
| 銀行券                   | 200               |        | 500                                                                                                       |        | 400               |     |    |     |      |   |
| 財政                    | ▲ 63,700          |        | 5,900                                                                                                     |        | 2,000             |     |    |     |      |   |
| 資金過不足                 | ▲ 63,500          |        | 6,400                                                                                                     |        | 2,400             |     |    |     |      |   |
| 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                  |                   |        | 12,900                                                                                                    |        |                   |     |    |     |      |   |
| CP等買入                 |                   | ▲ 100  |                                                                                                           | ▲ 500  |                   |     |    |     |      |   |
| 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                | ▲ 26,000          | 29,200 |                                                                                                           | 26,000 |                   |     |    |     |      |   |
| ※ F T L 資金供給用国債国債供給   |                   |        |                                                                                                           |        |                   |     |    |     |      |   |
| 当預増減                  | ▲ 60,500          |        | 44,800                                                                                                    |        | 2,400             |     |    |     |      |   |
| 当座預金残高                | 5,420,900         |        | 5,465,700                                                                                                 |        | 5,468,100         |     |    |     |      |   |
| 準備預金残高                | 4,852,000         |        | <div>8月5日以降の残り所要積立額</div> <table><tr><td>積数</td><td>500</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table> |        |                   |     | 積数 | 500 | 1日平均 | 0 |
| 積数                    | 500               |        |                                                                                                           |        |                   |     |    |     |      |   |
| 1日平均                  | 0                 |        |                                                                                                           |        |                   |     |    |     |      |   |
| 積み終了先                 | 4,851,900         |        |                                                                                                           |        |                   |     |    |     |      |   |
| 超過準備                  | 4,851,900         |        |                                                                                                           |        |                   |     |    |     |      |   |
| 非準備預金先                | 568,900           |        |                                                                                                           |        |                   |     |    |     |      |   |
| 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                |        | 99.99%                                                                                                    | 日数     | 64.52%            |     |    |     |      |   |

## ●2024年8月2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資金調達ニーズが強く、出合い水準は0.225~0.228%程度で推移した。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.005~0.23%程度での出合いとなった。  
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＞

2日はTB3M物(第1247回)の入札が実施され、事前予想より強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

### ＜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

| 2024/8/2 | 無担(速報) |       |       | 有担(速報) |    |    | 短国    | 東京<br>レポレート |
|----------|--------|-------|-------|--------|----|----|-------|-------------|
| 単位：%     | 最低     | 最高    | 平均    | 最低     | 最高 | 平均 | 売買参考値 | 平均値         |
| O/N      | 0.215  | 0.228 | 0.227 |        |    |    | -     | 0.220       |
| T/N      |        |       |       |        |    |    | -     | 0.228       |
| S/N      |        |       |       |        |    |    | -     | -           |
| 1W       |        |       |       |        |    |    | -     | 0.192       |
| 2W       |        |       | 0.230 |        |    |    | -     | 0.192       |
| 3W       |        |       |       |        |    |    | -     | 0.191       |
| 1M       | 0.310  | 0.460 | 0.361 |        |    |    | -     | 0.192       |
| 3M       |        |       | 0.350 |        |    |    | 0.125 | 0.203       |
| 6M       |        |       |       |        |    |    | 0.150 | 0.254       |
| 1Y       |        |       |       |        |    |    | 0.275 | 0.332       |

| 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)   |
| 0.955     | ▲ 0.075 | 35,909.70 | ▲ 2,216.63 | 149.19-21 | 149.20-23 |

| 日付        | 7/26      | 7/29      | 7/30      | 7/31      | 8/1       |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 日銀当預残     | 5,479,900 | 5,480,300 | 5,495,100 | 5,484,800 | 5,481,400 |
| 準備預金残     | 4,884,600 | 4,901,700 | 4,899,000 | 4,896,500 | 4,913,200 |
| マネタリーベース  | 6,725,900 | 6,726,200 | 6,741,400 | 6,731,200 | 6,727,600 |
| 無担O/N加重平均 | 0.078%    | 0.077%    | 0.077%    | 0.079%    | 0.227%    |
| コール市場残高   | 110,415   | 113,834   | 111,319   | 111,823   | 108,825   |
| うち無担      | 74,593    | 77,626    | 75,242    | 76,621    | 71,650    |
| うちO/N     | 29,381    | 32,694    | 30,310    | 33,926    | 29,553    |
| うち有担      | 35,822    | 36,208    | 36,077    | 35,202    | 37,175    |

## ●入札結果

| 名称     | 回号   | 表面<br>利率 | 発行<br>予定額 | 発行日      | 償還日       | 応募額<br>(億円) | 募入額<br>(億円) | 募入<br>最低額 | 募入最高利回・利<br>回差 | 案分率      | 募入<br>平均価格 | 募入平均利回・利<br>回差 | 第I非価格<br>競争入札(億円) |
|--------|------|----------|-----------|----------|-----------|-------------|-------------|-----------|----------------|----------|------------|----------------|-------------------|
| 国庫短期証券 | 1247 | -        | 52,000    | 2024/8/5 | 2024/11/5 | 144,252     | 39,473.7    | 99.9670   | 0.1309%        | 44.9889% | 99.9695    | 0.1210%        | 12,526            |

## ●オペ結果

| 種類                        | オファー額<br>(億円・<br>百万ドル) | スタート日    | エンド日     | 貸付<br>利率 | 応札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 落札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 按分レート<br>・利回差<br>・価格差 | 全取レート<br>・利回差<br>・価格差 | 平均落札レート<br>・利回差<br>・価格差 | 按分<br>比率 |
|---------------------------|------------------------|----------|----------|----------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|----------|
| 国債買入(残存期間1年以下)            | 1,500                  | 2024/8/5 |          |          | 3,080                 | 1,501                 | ▲0.028                |                       | ▲0.003                  | 18.4     |
| 国債買入(残存期間1年超3年以下)         | 3,500                  | 2024/8/5 |          |          | 9,722                 | 3,501                 | ▲0.046                |                       | ▲0.039                  | 71.6     |
| 国債買入(残存期間3年超5年以下)         | 3,750                  | 2024/8/5 |          |          | 9,423                 | 3,754                 | ▲0.060                |                       | ▲0.057                  | 52.7     |
| 国債買入(残存期間5年超10年以下)        | 4,000                  | 2024/8/5 |          |          | 9,742                 | 4,007                 | ▲0.067                |                       | ▲0.065                  | 48.5     |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) |                        | 2024/8/2 | 2024/8/5 | ▲0.050   | 26,788                | 26,788                |                       | ▲0.050                | ▲0.050                  |          |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) |                        | 2024/8/2 | 2024/8/5 | ▲0.050   | 38                    | 38                    |                       | ▲0.050                | ▲0.050                  |          |

## ●2024年8月5日の予定

\*8月の日銀当座預金増減要因見込み  
\*金融政策決定会合議事要旨(6月13・14日分)

\*7月のISM非製造業景況指数

◆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