

●資金需給

●2024年8月5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ており、出合いの水準は0.225～0.228%程度と横ばい圏で推移した。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0～0.15%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＞
5日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、すべてのカレント銘柄で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、大型発行を含めて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

2024/8/5	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	0.210	0.228	0.227				－	0.051
T/N							－	0.147
S/N							－	－
1W							－	0.162
2W			0.290				－	0.171
3W			0.380				－	0.179
1M	0.285	0.350	0.308				－	0.184
3M			0.350				0.070	0.201
6M							0.119	0.254
1Y							0.175	0.329

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)
0.754	▲ 0.201	31,458.42	▲ 4,451.28	145.58-60	143.47-52

日付	7/29	7/30	7/31	8/1	8/2
日銀当預残	5,480,300	5,495,100	5,484,800	5,481,400	5,420,900
準備預金残	4,901,700	4,899,000	4,896,500	4,913,200	4,852,000
マネタリーベース	6,726,200	6,741,400	6,731,200	6,727,600	6,666,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.079%	0.227%	0.227%
コール市場残高	113,834	111,319	111,823	108,825	110,366
うち無担	77,626	75,242	76,621	71,650	73,387
うちO/N	32,694	30,310	33,926	29,553	30,320
うち有担	36,208	36,077	35,202	37,175	36,979

●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）		2024/8/5	2024/8/6	▲0.050	33,092	33,092		▲0.050	▲0.051	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/8/5	2024/8/6	▲0.050	0	0				

●2024年8月6日の予定

*6月の全世帯家計調査（市場予想：消費支出、前年比▲0.9%） *6月の毎月勤労統計調査速報	*6月の米貿易収支	*10年利付国債入札 （26,000億円、8/7発行） *交付税特別会計借入 （12,500億円、8/15借入）
---	-----------	---

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されていますが、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