

Central Daily Market Report

2024年8月6日（火）
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6日 需給速報	2024年8月7日 需給予想	2024年8月8日 当社予想							
銀行券	400	200	▲ 1,000							
財政	4,700	▲ 20,900	1,000							
資金過不足	5,100	▲ 20,700	0							
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	▲ 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		▲ 100		▲ 400						
貸出支援基金（成）										
貸出支援基金（貸）										
被災地支援										
社債等買入										
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 25,400	32,200		25,400						
※ドル資金供給用信託資産供給										
当預増減	11,800		4,300		0					
当座預金残高	5,444,200		5,448,500		5,448,500					
準備預金残高	4,861,700		8月7日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>400</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				積数	400	1日平均	0
積数	400									
1日平均	0									
積み終了先	4,861,600									
超過準備	4,861,600									
非準備預金先	582,500									
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		70.97%					

●2024年8月6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、0.08～0.245%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＞
6日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

＜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

2024/8/6	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	0.220	0.228	0.227				－	0.046
T/N							－	0.115
S/N							－	－
1W	0.227	0.390	0.249				－	0.154
2W							－	0.165
3W							－	0.172
1M	0.300	0.350	0.319				－	0.175
3M	0.330	0.370	0.365				0.070	0.200
6M							0.100	0.254
1Y							0.185	0.328

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	+0.131	34,675.46	+3,217.04	145.78-83	145.29-31

日付	7/30	7/31	8/1	8/2	8/5
日銀当預残	5,495,100	5,484,800	5,481,400	5,420,900	5,432,400
準備預金残	4,899,000	4,896,500	4,913,200	4,852,000	4,851,500
マネタリーベース	6,741,400	6,731,200	6,727,600	6,666,900	6,677,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.079%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	111,319	111,823	108,825	110,366	117,372
うち無担	75,242	76,621	71,650	73,387	82,594
うちO/N	30,310	33,926	29,553	30,320	38,807
うち有担	36,077	35,202	37,175	36,979	34,778

●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・利 回較差	案分率	募入 平均価格	募入平均利回・利 回較差	第1非償 格競争入札（億円）	非競争 入札（億円）
10年利付国債	375	1.1%	26,000	2024/8/7	2034/6/20	58,529	19,673	101.07	0.981%	21.3663%	101.57	0.926%	6,313	13.01
交付税特会	－	－	12,500	2024/8/15	2025/2/14	53,055	12,490		0.293%	35.7143%		0.259%		10

●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
米ドル資金供給		2024/8/8	2024/8/15	5.540	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/8/6	2024/8/7	▲0.150	25,706	25,706		▲0.150	▲0.150	
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	8,000	2024/8/7	2024/8/21	0.250	8,687	8,004				92.1
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/8/6	2024/8/7	▲0.150	6	6		▲0.150	▲0.150	

●2024年8月7日の予定

*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *6月の景気動向指数速報	*6月の米消費者信用残高
◆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	