

# Central Daily Market Report

2024年8月7日(水)

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7日 需給速報	2024年8月8日 需給予想	2024年8月9日 当社予想
銀行券	200	▲ 500	▲ 500
財政	▲ 24,200	500	▲ 11,000
資金過不足	▲ 24,000	0	▲ 11,500

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	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,400			
CP等買入		▲ 400	▲ 200			
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	▲ 22,100	25,400	22,100			
当預増減	▲ 21,100		30,300		▲ 11,500	

当座預金残高	5,423,100	5,453,400	5,441,900	
準備預金残高	4,847,400			
積み終了先	4,847,400			
超過準備	4,847,400			
非準備預金先	575,700			
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			4,075,700	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	74.19%

## ●2024年8月7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、0.155~0.245%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>

7日のアウトライ市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の業態で入札が実施された。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

2024/8/7	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	0.215	0.229	0.227				-	0.213
T/N							-	0.151
S/N							-	-
1W	0.228	0.300	0.236				-	0.154
2W	0.325	0.330	0.328				-	0.164
3W							-	0.172
1M			0.320				-	0.176
3M			0.350				0.070	0.201
6M							0.100	0.254
1Y							0.160	0.326

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)
0.875	▲ 0.010	35,089.62	+414.16	144.74-77	146.68-71
日付	7/31	8/1	8/2	8/5	8/6
日銀当預残	5,484,800	5,481,400	5,420,900	5,432,400	5,444,200
準備預金残	4,896,500	4,913,200	4,852,000	4,851,500	4,864,000
マネタリーベース	6,731,200	6,727,600	6,666,900	6,677,900	6,689,300
無担O/N加重平均	0.079%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	111,823	108,825	110,366	117,372	119,549
うち無担	76,621	71,650	73,387	82,594	83,441
うちO/N	33,926	29,553	30,320	38,807	38,824
うち有担	35,202	37,175	36,979	34,778	36,108

## ●入札結果

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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,500	2024/8/8			9,874	3,502	▲0.033		▲0.028	97.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,750	2024/8/8			11,462	3,752	▲0.029		▲0.023	33.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/8/8			2,800	1,501	0.002		0.012	87.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/8/7	2024/8/8	▲0.150	22,386	22,248		▲0.150	▲0.162	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/7	2024/8/8	▲0.150	305	305		▲0.150	▲0.150	

## ●2024年8月8日の予定

\*決定会合における主な意見(7月30・31日分)  
\*6月の国際収支  
\*7月の景気ウォッチャー調査

\*6月の米卸売売上高

\*国庫短期証券(1248回)入札  
(6ヶ月、37,000億円、8/13発行)  
\*30年利付国債入札  
(9,000億円、8/9発行)  
\*エネルギー対策借入  
(4,493億円、8/20借入)

◆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