

Central Daily Market Report

2024年8月8日(木)

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8日 需給速報	2024年8月9日 需給予想	2024年8月13日 当社予想
銀行券	▲ 500	▲ 300	1,000
財政	▲ 1,500	▲ 11,000	10,500
資金過不足	▲ 2,000	▲ 11,300	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	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	8,400							
CP等買入		▲ 200		▲ 700				
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	▲ 23,000	22,100		23,000				
当預増減	5,300		11,000		11,500			

当座預金残高	5,428,400	5,439,400	5,450,900	
準備預金残高	4,853,100			
積み終了先	4,853,000	8月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,853,000	積数	200	
非準備預金先	575,300	1日平均	0	
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	100.00%	日数	77.42%

●短期金融市場関連指標

2024/8/8	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				-	0.216
T/N							-	0.174
S/N							-	-
1W			0.350				-	0.162
2W			0.300				-	0.167
3W							-	0.172
1M							-	0.177
3M	0.330	0.730	0.387				0.070	0.201
6M							0.095	0.257
1Y							0.160	0.325

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)
0.830	▲ 0.045	34,831.15	▲ 258.47	146.27-30	145.84-87
日付	8/1	8/2	8/5	8/6	8/7
日銀当預残	5,481,400	5,420,900	5,432,400	5,444,200	5,423,100
準備預金残	4,913,200	4,852,000	4,851,500	4,864,000	4,845,500
マネタリーベース	6,727,600	6,666,900	6,677,900	6,689,300	6,668,000
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	108,825	110,366	117,372	119,549	121,681
うち無担	71,650	73,387	82,594	83,441	85,190
うちO/N	29,553	30,320	38,807	38,824	40,403
うち有担	37,175	36,979	34,778	36,108	36,491

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1248	-	37,000	2024/8/13	2025/2/10	95,058	28,265.7	99.945	0.1109%	81.5135%	99.953	0.0948%	8,734
30年利付国債	83	2.2%	9,000	2024/8/9	2054/6/20	24,528	7,073	99.30	2.239%	6.0046%	99.47	2.229%	1,922
エネルギー対策	-	-	4,493	2024/8/20	2025/8/20	29,747	4,493		0.396%	78.0000%		0.358%	

●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)		2024/8/8	2024/8/9	▲0.050	23,471	23,471		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/8/8	2024/8/9	▲0.050	15	15		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月9日の予定

*7月のマネーストック	*国庫短期証券(1249回)入札
*6月の特定サービス産業動態統計速報	(3ヶ月、49,000億円、8/13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