

Central Daily Market Report

2024年8月9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9日 需給速報	2024年8月13日 需給予想	2024年8月14日 当社予想			
銀行券	▲ 300	0	1,000			
財政	▲ 10,500	6,800	1,000			
資金過不足	▲ 10,800	6,800	2,000			
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						
CP等買入		▲ 700		▲ 100		
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	▲ 19,000	23,000		19,000		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 7,500		25,700		2,000	
当座預金残高	5,420,900		5,446,600		5,448,600	
準備預金残高	4,836,300					
積み終了先	4,836,200				8月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,836,200				積数	100
非準備預金先	584,600				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	90.32%		

●2024年8月9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、連休前の取引となったものの、目立った変化はなく、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たことで、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、0.19～0.24%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＞

9日はTB3M物（第1249回）の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小甘く推移した。この他、6M物と1Y物でも出合いが見られた。

＜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

2024/8/9	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	売買参考値	平均値
O/N	0.200	0.229	0.227				－	0.182
T/N							－	0.233
S/N							－	－
1W							－	0.175
2W							－	0.172
3W							－	0.175
1M			0.330				－	0.178
3M	0.330	0.350	0.348				0.090	0.201
6M							0.100	0.255
1Y							0.160	0.321

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)
0.855	+0.025	35,025.00	+193.85	147.69-71	147.20-22

日付	8/2	8/5	8/6	8/7	8/8
日銀当預残	5,420,900	5,432,400	5,444,200	5,423,100	5,428,400
準備預金残	4,852,000	4,851,500	4,864,000	4,845,500	4,853,100
マネタリーベース	6,666,900	6,677,900	6,689,300	6,668,000	6,673,800
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	110,366	117,372	119,549	121,681	115,016
うち無担	73,387	82,594	83,441	85,190	78,713
うちO/N	30,320	38,807	38,824	40,403	33,566
うち有担	36,979	34,778	36,108	36,491	36,303

●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	1249	－	49,000	2024/8/13	2024/11/11	111,836	37,182.6	99.9760	0.0973%	95.2304%	99.9788	0.0859%	11,817

●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（午前オフア一分）		2024/8/9	2024/8/13	▲0.050	19,178	19,178		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オフア一分）		2024/8/9	2024/8/13	▲0.050	200	200		▲0.050	▲0.050	

●2024年8月12日の予定

*振替休日	*7月の米財政収支
-------	-----------

●2024年8月13日の予定

*7月の企業物価指数	*7月の米生産者物価指数
------------	--------------

◆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ものがあります。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