Central Daily Market Report

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需約

単位:億円 2024年8月9日 需給 予想 2024年8月13日 当社 予想 300 0 1,000 万金 過不足 ▲ 10,800 6,800 2,000 金融調節 スタート エンド 日間 原質 現 国債 売現 国庫短期証買入 国債 買入 (ア等 買入 本 700 本 100 分別 対し支援基金(球) 対し支援基金(球) 対し支援基金(球) 対し支援基金(球) 対し支援基金(球) 対し支援基金(球) 対し支援 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 本 19,000 23,000 19,000 またが発生機能再級素の 本 7,500 25,700 2,000 当 上 19,000 表 1	●貧金需給					
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 は出 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 資出支援基金(球) 資出支援基金(球) 接出支援基金(球) 接出支援基金(球) 接出支援基金(球) 接出支援基金(球) を 100 日 19,000 23,000 19	単位:億円					
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	銀行券	▲ 300	0	1, 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 国庫短期証買入 の子等買入 ▲ 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 ETF買入 国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,00	財政	▲ 10, 500	6, 800	1, 000		
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 対立支援基金(成) 対出支援基金(資) 被災地支援 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,000 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 準備預金終高 4,836,200 最過準備 4,836,200 非準備預金先 584,600	資金過不足	1 0,800	6, 800	2, 000		
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 ☆出支援基金(成) ☆出支援基金(食) 被災地支援 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,000 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 非準備預金先 584,600 1日平均 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		
国債買現 国債売現 国庫短期証買入 国債買入 CP等買入 食出支援基金(成) 食出支援基金(食) 被災地支援 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 メトルの中華制度が開発に対した。 本 7,500 25,700 2,000 当産預金残高 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 非準備預金先 584,600 8月13日以降の残り所要積立額 積数 100 1日平均 0	貸出					
国債売現 国庫短期証買入 国債買入 CP等買入 食出支援基金(成) 食出支援基金(貸) 被災地支援 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 メドルの中部周囲原理機能 ※ 7,500 25,700 2,000 当産預金残高 5,420,900 5,446,600 5,448,600 準備預金残高 4,836,300 権み終了先 4,836,200 超過準備 4,836,200 非準備預金先 584,600	全店共通					
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 ETF買入 国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,000 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 準備預会残高 4,836,300 積み終了先 4,836,200 超過準備 4,836,200 非準備預金先 584,600	国債買現					
国債買入 CP等買入	国債売現					
CP等買入						
貸出支援基金 (成) 貸出支援基金 (貸) 被災地支援	国債買入					
貸出支援基金 (貸) 被災地支援	CP等買入	▲ 700	▲ 100			
被災地支援 社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,000 2,000 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 超過準備 4,836,200 非準備預金先 584,600 19平均 0	貸出支援基金(成)					
社債等買入 気候変動対応オペ ETF買入 国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,000 1	貸出支援基金(貸)					
気候変動対応オペ ETF買入 19,000 23,000 19,00	被災地支援					
ETF買入 国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,00	社債等買入					
国債補完供給 ▲ 19,000 23,000 19,000 25,000 19,000 当預増減 ▲ 7,500 25,700 2,000 3 19,000 3 19,000 25,000 3 19	気候変動対応オペ					
### 第36	ETF買入					
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 超過準備 4,836,200 非準備預金先 584,600 1日平均 0	国債補完供給	▲ 19,000 23,000	19, 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 超過準備 4,836,200 非準備預金先 584,600 1日平均 0	米ドル資金供給用担保国債供給					
準備預金残高 4,836,300 積み終了先 4,836,200 超過準備 4,836,200 積数 100 非準備預金先 584,600 1日平均 0	当預増減	▲ 7, 500	25, 700	2, 000		
積み終了先	当座預金残高	5, 420, 900	5, 446, 600	5, 448, 600		
超過準備 4,836,200 積数 100 非準備預金先 584,600 1日平均 0	準備預金残高	4, 836, 300		, ,		
超過準備 4,836,200 積数 100 非準備預金先 584,600 1日平均 0	積み終了先	4, 836, 200	8月13日以	降の残り所要積立額		
			積数	100		
積み期間 (7/16~8/15) の所要準備額 4,075,700	非準備預金先	584, 600	1日平均			
	積み期間(7/16~	・8/15) の所要準	備額	4, 075, 700		

●2024年8月9日の市場動向

〈インターパンク市場〉

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

準備預金進捗率 実績

2024/8/9		無担(速報)			有担 (速報)		短国	東京 レポレート	
単位:%	位:% 最低 最高		平均	最低	最高	平均	売買参考統計值	平均值	
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	

100.00% 日数

	JC	B新	「発10年債 日経平均株価 ドル/円			9						
	直边	直近値 前日比		15時時点 前日比			為替(9時) 為替(17時					
	8.0	355	+0.	025	35	35,025.00		193.85		147.69-71	1.	47.20-22
		日付	t	8/2	2	2 8/5 8		8/6		8/7	I	8/8
	日銀当預残			5,420,	900	900 5,432,4		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		6,689,30	00	6,668,000		6,673,800
	無担O	/N加	重平均	0.2	27%	0.227%		0.227%		7% 0.227%		0.227%
	コール市場残高			110,	366	117,3	72	119,5	49	121,681	1	115,016
	うち無担 うちO/N		73,	387	82,5	94	83,4	4	85,190		78,713	
			30,	320	38,8	07	38,88	24	40,403	3	33,566	
うち有担			36,	979	34,7	78	36,10	08	36,491	ıſ	36,303	

●入札結果

名称	0	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	東分率	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	券 12	49	-	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

O 1 THAN										
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	•利回較差	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		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(午後オファー分)		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

90. 32%

●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