

Central Daily Market Report

2024年7月22日(月)
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7月22日 需給速報		2024年7月23日 需給予想		2024年7月24日 当社予想	
銀行券	500		700		1,500	
財政	13,000		▲ 6,200		▲ 1,000	
資金過不足	13,500		▲ 5,500		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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 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		▲ 200			800	
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 23,600	21,400		23,600		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	10,900		18,100		▲ 6,700	
当座預金残高	5,452,900		5,471,000		5,464,300	
準備預金残高	4,871,700					
積み終了先	4,870,000				7月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,869,100				積数	9,300
非準備預金先	581,200				1日平均	400
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 99.77%		日数 22.58%			

●2024年7月22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、0.075～0.078%程度での出会いが中心であったが、一部試し取りの動きが見られた。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.07～0.085%程度での出会いとなった。
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＞
22日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2024/7/22	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	0.070	0.125	0.083				－	0.092
T/N							－	0.081
S/N							－	－
1W			0.078				－	0.055
2W	0.160	0.180	0.170				－	0.056
3W							－	0.056
1M							－	0.058
3M							0.020	0.088
6M							0.020	0.143
1Y							0.160	0.200

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)
1.050	+0.010	39,599.00	▲ 464.79	157.40-42	156.81-83

日付	7/12	7/16	7/17	7/18	7/19
日銀当預残	5,428,500	5,397,600	5,375,600	5,395,300	5,442,000
準備預金残	4,830,700	4,810,100	4,785,500	4,802,600	4,845,700
マネタリーベース	6,679,700	6,647,700	6,624,300	6,643,100	6,688,600
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.078%	0.077%	0.077%
コール市場残高	114,954	118,547	120,095	122,473	120,136
うち無担	75,197	78,974	80,798	83,459	81,119
うちO/N	31,520	34,562	36,076	38,837	35,617
うち有担	39,757	39,573	39,297	39,014	39,017

●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)
流動性供給	410	－	5,000	2024/7/23	－	16,245	4,987		▲0.008%	55.4399%		▲0.012%	

●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)		2024/7/22	2024/7/23	▲0.150	24,279	24,279		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/22	2024/7/23	▲0.150	0	0				

●2024年7月23日の予定

*6月の米中古住宅販売件数	*交付税特別会計借入 (13,000億円、7/31借入)
---------------	---------------------------------

◆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