

# Central Daily Market Report

2024年7月24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7月24日 需給速報	2024年7月25日 需給予想	2024年7月26日 当社予想			
銀行券	0	▲ 500	▲ 500			
財政	▲ 3,300	6,500	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 3,300	6,000	▲ 1,500			
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	12,200					
CP等買入		▲ 200	▲ 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	700		▲ 300			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 22,000	20,800	22,000			
当預増減	8,200	27,600	▲ 1,500			
当座預金残高	5,461,600	5,489,200	5,487,700			
準備預金残高	4,868,300					
積み終了先	4,867,100			7月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,867,000			積数	6,200	
非準備預金先	593,300			1日平均	300	
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	99.85%	日数	29.03%		

## ●2024年7月24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%程度での出合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、0.02~0.06%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>

24日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物と6M物で出合いが見られた。

### <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

2024/7/24	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	0.070	0.125	0.080				-	0.043
T/N							-	0.045
S/N							-	-
1W	0.078	0.220	0.107				-	0.052
2W			0.180				-	0.054
3W							-	0.056
1M							-	0.059
3M							0.025	0.090
6M							0.035	0.144
1Y							0.165	0.202

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)
1.070	+0.010	39,154.85	▲ 439.54	155.76-78	154.58-60
日付	7/17	7/18	7/19	7/22	7/23
日銀当預残	5,375,600	5,395,300	5,442,000	5,452,900	5,453,400
準備預金残	4,785,500	4,802,600	4,845,700	4,872,100	4,882,800
マネタリーベース	6,624,300	6,643,100	6,688,600	6,699,000	6,698,800
無担O/N加重平均	0.078%	0.077%	0.077%	0.083%	0.080%
コール市場残高	120,095	122,473	120,136	120,253	118,911
うち無担	80,798	83,459	81,119	81,230	80,933
うちO/N	36,076	38,837	35,617	35,738	34,891
うち有担	39,297	39,014	39,017	39,023	37,978

## ●入札結果

名称	回数	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非價格競争入札(億円)
40年利付国債	17	2.2%	7,000	2024/7/25	2064/3/20	15,390	6,997	94.41	2.420%	98.4126%			

## ●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)		2024/7/24	2024/7/25	▲0.150	22,706	22,706		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/24	2024/7/25	▲0.150	0	0				

## ●2024年7月25日の予定

*月例経済報告	*4-6月期の米GDP速報値	*交付税特別会計借入
*6月の企業向けサービス価格指数	*6月の米耐久財新規受注	(12,500億円、8/5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