

Central Daily Market Report

2024年7月25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7月25日 需給速報	2024年7月26日 需給予想	2024年7月29日 当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 100	1,000
財政	6,600	11,400	11,000
資金過不足	6,000	11,300	12,000

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		▲ 100		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 20,100	22,000		20,100		
当預増減	7,500		30,700		12,000	

当座預金残高	5,469,100	5,499,800	5,511,800	
準備預金残高	4,883,200			
積み終了先	4,882,200			
超過準備	4,882,100			
非準備預金先	585,900			
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	99.88%	日数	32.26%

●2024年7月25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、0.03~0.05%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>

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数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

2024/7/25	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	売買参考値	平均値
O/N	0.070	0.125	0.081				-	0.065
T/N							-	0.033
S/N							-	-
1W			0.240				-	0.049
2W	0.160	0.190	0.175				-	0.056
3W			0.150				-	0.058
1M	0.190	0.290	0.236				-	0.069
3M							0.050	0.096
6M							0.045	0.147
1Y							0.170	0.207

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)
1.065	▲ 0.005	37,869.51	▲ 1.285.34	153.91-94	152.18-21
日付	7/18	7/19	7/22	7/23	7/24
日銀当預残	5,395,300	5,442,000	5,452,900	5,453,400	5,461,600
準備預金残	4,802,600	4,845,700	4,872,100	4,882,800	4,868,300
マネタリーベース	6,643,100	6,688,600	6,699,000	6,698,800	6,707,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.083%	0.080%	0.080%
コール市場残高	122,473	120,136	120,253	118,911	115,769
うち無担	83,459	81,119	81,230	80,933	77,806
うちO/N	38,837	35,617	35,738	34,891	32,634
うち有担	39,014	39,017	39,023	37,978	37,963

●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1非償額募入札(億円)	非償募入札(億円)
交付税特会	-	-	12,500	2024/8/5	2025/2/4	61,013	12,490		0.228%	81.0000%		0.209%		10

●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	応募総額(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)		2024/7/25	2024/7/26	▲0.250	20,772	20,772		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/25	2024/7/26	▲0.250	0	0				

●2024年7月26日の予定

*7月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.2%)	*6月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1246回)入札 (3ヶ月、52,000億円、7/29発行)
*5月の景気動向指数改訂状況		*2年利付国債入札 (26,000億円、8/1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