

Central Daily Market Report

2024年7月26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7月26日 需給速報		2024年7月29日 需給予想		2024年7月30日 当社予想					
銀行券	▲ 100		200		▲ 500					
財政	9,900		6,300		500					
資金過不足	9,800		6,500		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				
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		▲ 600		▲ 500						
貸出支援基金（成）										
貸出支援基金（貸）										
被災地支援										
社債等買入		▲ 100		▲ 100						
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 18,400	20,100		18,400						
※ドル資金供給用国債国債供給										
当預増減	10,800		24,300		0					
当座預金残高	5,479,900		5,504,200		5,504,200					
準備預金残高	4,884,600		7月29日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>2.200</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>100</td></tr></table>				積数	2.200	1日平均	100
積数	2.200									
1日平均	100									
積み終了先	4,883,800									
超過準備	4,883,700									
非準備預金先	595,300									
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 99.95%		日数		41.94%					

●2024年7月26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だった。

＜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＞
26日はTB3M物（第1246回）の入札が実施され、事前予想よりも強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは堅調に推移した。

＜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。
また、26日にはCP等買入オペが事前予定通り3,000億円でオファーされた。結果は、全取レート0.226%、平均落札レート0.246%と、前回（按分0.191%、平均0.200%）比で最低落札レート、平均落札レートともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2024/7/26	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	0.078	0.078				－	0.079
T/N							－	0.078
S/N							－	－
1W			0.230				－	0.067
2W			0.180				－	0.070
3W							－	0.071
1M							－	0.080
3M			0.210				0.057	0.108
6M							0.045	0.153
1Y							0.170	0.209

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)
1.055	▲ 0.010	37,667.41	▲ 202.10	153.69-72	153.91-93

日付	7/19	7/22	7/23	7/24	7/25
日銀当預残	5,442,000	5,452,900	5,453,400	5,461,600	5,469,100
準備預金残	4,845,700	4,872,100	4,882,800	4,868,300	4,883,200
マネタリーベース	6,688,600	6,699,000	6,698,800	6,707,000	6,715,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.083%	0.080%	0.080%	0.081%
コール市場残高	120,136	120,253	118,911	115,769	115,193
うち無担	81,119	81,230	80,933	77,806	78,049
うちO/N	35,617	35,738	34,891	32,634	32,827
うち有担	39,017	39,023	37,978	37,963	37,144

●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1非備 格競争入 札（億円）	非競争 入札（億 円）
国庫短期証券	1246	－	52,000	2024/7/29	2024/10/28	130,372	39,334.6	99.9840	0.0641%	12.4339%	99.9859	0.0565%	12,665	
2年利付国債	463	0.4%	26,000	2024/8/1	2026/8/1	82,708	19,754	99.975	0.412%	63.1243%	99.982	0.409%	6,239	2.3

●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
CP等買入	3,000	2024/7/31			7,368	2,990		0.226	0.246	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/7/26	2024/7/29	▲ 0.250	18,965	18,965		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/7/26	2024/7/29	▲ 0.250	50	50		▲ 0.250	▲ 0.250	

●2024年7月29日の予定

*特にありません

◆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