

Central Daily Market Report

2024年7月29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29日 需給速報	2024年7月30日 需給予想	2024年7月31日 当社予想
銀行券	200	▲ 400	▲ 600
財政	2,900	4,900	500
資金過不足	3,100	4,500	▲ 100

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			11,500			
CP等買入		▲ 500	▲ 100	3,000		
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				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 20,500	18,400	20,500			
当預増減	400	36,400	2,900			

当座預金残高	5,480,300	5,516,700	5,519,600
準備預金残高	4,901,700		
積み終了先	4,900,900	7月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,900,900	積数	1,400
非準備預金先	578,600	1日平均	100
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 99.97%	日数	45.16%

●短期金融市場関連指標

2024/7/29	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	0.078	0.077				-	0.081
T/N							-	0.074
S/N							-	-
1W	0.078	0.250	0.081				-	0.074
2W							-	0.077
3W							-	0.079
1M							-	0.090
3M							0.057	0.115
6M							0.045	0.155
1Y							0.170	0.211

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)
1.025	▲ 0.030	38,468.63	+801.22	154.15-17	153.61-63
日付	7/22	7/23	7/24	7/25	7/26
日銀当預残	5,452,900	5,453,400	5,461,600	5,469,100	5,479,900
準備預金残	4,872,100	4,882,800	4,868,300	4,883,200	4,884,600
マネタリーベース	6,699,000	6,698,800	6,707,000	6,715,000	6,725,900
無担O/N加重平均	0.083%	0.080%	0.080%	0.081%	0.078%
コール市場残高	120,253	118,911	115,769	115,193	110,415
うち無担	81,230	80,933	77,806	78,049	74,593
うちO/N	35,738	34,891	32,634	32,827	29,381
うち有担	39,023	37,978	37,963	37,144	35,822

●入札結果

本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/7/30			9,453	4,255	▲0.022		▲0.019	39.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/7/30			8,010	4,255	▲0.024		▲0.022	30.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/7/30			3,279	1,502	▲0.022		▲0.019	10.9
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/7/30			2,268	752	▲0.018		▲0.017	73.0
国債買入(物価連動債)	600	2024/7/30			1,997	600	0.440		0.219	23.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/29	2024/7/30	▲0.150	21,135	21,135		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/29	2024/7/30	▲0.150	0	0				

●2024年7月30日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、31日まで)
*6月の完全失業率(市場予想: 2.6%)
*6月の有効求人倍率(市場予想: 1.24倍)

*米FOMC(1日目)
*5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*7月の米CB消費者信頼感指数
*4-6月期のユーロ圏GDP1次速報

*交付税特別会計借入
(12,500億円、8/8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