

Central Daily Market Report

2024年7月30日（火）
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30日 需給速報		2024年7月31日 需給予想		2024年8月1日 当社予想							
銀行券	▲ 400		▲ 100		▲ 400							
財政	3,700		▲ 1,700		▲ 27,000							
資金過不足	3,300		▲ 1,800		▲ 27,400							
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		▲ 100	3,000	▲ 800								
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								
気候変動対応オペ												
E T F 買入												
国債補完供給	▲ 20,400	20,500		20,400								
※ドル資金供給用国債補完供給												
当預増減	14,800		20,500		▲ 27,400							
当座預金残高	5,495,100		5,515,600		5,488,200							
準備預金残高	4,899,100		<table><tr><td colspan="2">7月31日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>1,000</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>100</td></tr></table>				7月31日以降の残り所要積立額		積数	1,000	1日平均	100
7月31日以降の残り所要積立額												
積数	1,000											
1日平均	100											
積み終了先	4,899,000											
超過準備	4,898,700											
非準備預金先	596,000											
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	99.98%	日数	48.39%								

●2024年7月30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、引き続き邦銀業態からの資金調達ニーズが強く、レート水準についても0.075～0.078%程度で横ばい推移となった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.06～0.02%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＞

30日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、数件の入札が実施された。発行レートは0.1%以上で推移し、銘柄によって投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

2024/7/30	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	0.079	0.077				－	0.024
T/N							－	0.006
S/N							－	－
1W	0.100	0.120	0.113				－	0.069
2W							－	0.077
3W							－	0.080
1M							－	0.089
3M							0.057	0.119
6M							0.045	0.156
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)
0.995	▲ 0.030	38,525.95	+57.32	153.82-84	154.89-91

日付	7/23	7/24	7/25	7/26	7/29
日銀当預残	5,453,400	5,461,600	5,469,100	5,479,900	5,480,300
準備預金残	4,882,800	4,868,300	4,883,200	4,884,600	4,901,700
マネタリーベース	6,698,800	6,707,000	6,715,000	6,725,900	6,726,200
無担O/N加重平均	0.080%	0.080%	0.081%	0.078%	0.077%
コール市場残高	118,911	115,769	115,193	110,415	113,834
うち無担	80,933	77,806	78,049	74,593	77,626
うちO/N	34,891	32,634	32,827	29,381	32,694
うち有担	37,978	37,963	37,144	35,822	36,208

●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非面 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
交付税特会	－	－	12,500	2024/8/8	2025/2/7	60,325	12,490		0.240%	82.2110%		0.222%		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
米ドル資金供給		2024/8/1	2024/8/8	5.570	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/30	2024/7/31	▲ 0.150	20,985	20,985		▲ 0.150	▲ 0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/30	2024/7/31	▲ 0.150	0	0				

●2024年7月31日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*米FOMC(2日目)
*植田日銀総裁定例会見	*経済・物価情勢の展望
*6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲4.8%)	*7月のシカゴPM景況感指数
*6月の商業動態統計速報	*6月の住宅着工統計
*7月の消費動向調査	*7月のユーロ圏消費者物価指数速報値

◆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