

●資金需給

単位：億円	2024年7月31日 需給速報		2024年8月1日 需給予想		2024年8月2日 当社予想	
銀行券	0		0		100	
財政	▲ 9,400		2,300		▲ 59,000	
資金過不足	▲ 9,400		2,300		▲ 58,900	
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	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	▲ 23,200	20,400		23,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 10,300		25,500		▲ 58,900	
当座預金残高	5,484,800		5,510,300		5,451,400	
準備預金残高	4,896,500		8月1日以降の残り所要積立額 積数 900 1日平均 100			
積み終了先	4,896,400					
超過準備	4,896,400					
非準備預金先	588,300					
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 99.98%		日数		51.61%	

●短期金融市場関連指標

2024/7/31	無担(遠報)			有担(遠報)			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	0.280	0.079				-	▲ 0.062
T/N							-	0.100
S/N							-	-
1W			0.350				-	0.110
2W	0.300	0.350	0.321				-	0.111
3W			0.330				-	0.112
1M	0.340	0.350	0.343				-	0.117
3M			0.345				0.150	0.138
6M							0.150	0.176
1Y							0.275	0.230

●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)		2024/7/31	2024/8/1	▲0.250	23,905	23,905		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/31	2024/8/1	▲0.250	0	0				

●日銀 金融政策決定会合・結果

●金融市場調節方針の変更および長期国債買入の減額計画の決定について 1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した(賛成7反対2)。 無担保コールレート(オーバーナイト物)を、0.25%程度で推移するよう促す※1。 2. 長期国債買入の減額について、月間の長期国債の買入れ予定額を、原則として毎四半期4,000億円程度ずつ減額し、2026年1~3月に3兆円程度とする計画を決定した※2(全員一致)。 3. 上記の金融市場調節方針の変更に伴い、以下のとおり、各種制度の適用利率の変更等を決定した※3(賛成7反対2)。 (1) 補完当座預金制度の適用利率 補完当座預金制度の適用利率(日本銀行当座預金<所要準備額相当部分を除く>への付金利)については、0.25%とする。 (2) 基準貸付利率※4 補完貸付制度については、その適用金利である基準貸付利率を0.5%とする。 (3) 貸出増加支援資金供給等(新規実行分)に対する適用金利 被災地金融機関支援オペ、気候変動対応オペについては、貸付利率を0.25%とする。貸出増加支援資金供給については、変動金利貸付に変更のうえ※5、実施する。 ※1 新たな金融市場調節方針は、翌営業日(8月1日)から適用する。 ※2 CP等・社債等の買入れについては、2024年3月の金融政策決定会合において決定された方針に沿って実施する。 ※3 補完当座預金制度の適用利率および基準貸付利率は、翌営業日(8月1日)から適用する。また、金融調節の一層の円滑化を図る観点から、固定金利方式の国債売現先オペを新たに導入することとした。 ※4 日本銀行法第15条第1項第2号に規定する「基準となるべき貸付利率」。なお、同第1号の「基準となるべき割引率」も0.5%とする(手形割引の取り扱いは今後停止中)。 ※5 貸付利率は、貸付期間中の補完当座預金制度の適用利率の平均値とする。										
◆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										

●2024年7月31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。

金融政策決定会合では、政策金利の追加利上げに加え、国債買入れの減額計画が公表された。また、基準貸付利率や貸出増加支援オペ等の適用金利も変更された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.10~0.20%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＞

31日のアウトライト市場では、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は、数件の入札が実施された。発行レートは利上げの警戒からか0.2%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。

●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。
●2024年8月1日の予定
*英中銀MPC *7月のISM製造業景況指数 *6月の米建設支出

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	+0.060	39,101.82	+575.87	152.63-66	150.90-92
日付	7/24	7/25	7/26	7/29	7/30
日銀当預残	5,461,600	5,469,100	5,479,900	5,480,300	5,495,100
準備預金残	4,868,300	4,883,200	4,884,600	4,901,700	4,899,000
マネタリーベース	6,707,000	6,715,000	6,725,900	6,726,200	6,741,400
無担O/N加重平均	0.080%	0.081%	0.078%	0.077%	0.077%
コール市場残高	115,769	115,193	110,415	113,834	111,319
うち無担	77,806	78,049	74,593	77,626	75,242
うちO/N	32,634	32,827	29,381	32,694	30,310
うち有担	37,963	37,144	35,822	36,208	36,077