

●資金需給

単位：億円	2024年7月1日 需給速報		2024年7月2日 需給予想		2024年7月3日 当社予想	
銀行券	500		1,000		▲ 1,000	
財政	▲ 4,300		▲ 12,600		▲ 54,000	
資金過不足	▲ 3,800		▲ 11,600		▲ 55,000	
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	6,700					
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 26,500	25,400		26,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	1,800		14,900		▲ 55,000	
当座預金残高	5,519,600		5,534,500		5,479,500	
準備預金残高	4,928,600					
積み終了先	4,928,500				7月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,928,500				積数	600
非準備預金先	591,000				1日平均	0
積み期間(6/16～7/15)の所要準備額					3,942,000	
準備預金進捗率	実績		99.98%	日数	53.33%	

●2024年7月1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、期末要因の剥落により調達を再開する先が散見された。引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、出合いの水準は0.07~0.078%程度で推移した。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.055~0.085%程度での出合いとなった。
SCI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＞

1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、一部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

2024/7/1	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	0.079	0.077				-	0.076
T/N							-	0.061
S/N							-	-
1W							-	0.053
2W	0.110	0.300	0.160				-	0.051
3W							-	0.051
1M	0.135	0.210	0.181				-	0.051
3M							0.019	0.084
6M							▲ 0.005	0.139
1Y							0.150	0.200

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)
1.059	+0.019	39,631.06	+47.98	160.92-94	161.01-03

日付	6/24	6/25	6/26	6/27	6/28
日銀当預残	5,539,400	5,554,500	5,535,900	5,526,000	5,517,800
準備預金残	4,932,300	4,946,400	4,937,000	4,918,300	4,905,300
マネタリーベース	6,774,900	6,790,000	6,771,500	6,762,000	6,753,900
無担O/N加重平均	0.081%	0.078%	0.077%	0.077%	0.076%
コール市場残高	124,498	119,208	117,424	116,685	115,546
うち無担	86,750	81,627	79,744	79,177	79,425
うちO/N	40,101	35,168	33,545	33,908	39,831
うち有担	37,748	37,581	37,680	37,508	36,121

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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・利回り較差・価格較差	全取レート・利回り較差・価格較差	平均落札レート・利回り較差・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)		2024/7/1	2024/7/2	▲0.250	27,132	27,132		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/1	2024/7/2	▲0.250	0	0				

●2024年7月2日の予定

*6月のマネタリーベース	*6月のユーロ圏消費者物価指数速報値	*10年利付国債入札(26,000億円、7/3発行)
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み		

◆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