

Central Daily Market Report

2024年7月2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2日 需給速報	2024年7月3日 需給予想	2024年7月4日 当社予想
銀行券	1,100	▲ 15,400	▲ 500
財政	▲ 6,200	▲ 57,500	0

資金過不足	▲ 5,100	▲ 72,900	▲ 500
-------	---------	----------	-------

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						
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	▲ 31,000	26,500		31,000		

当預増減	▲ 9,600	▲ 41,900	▲ 500
------	---------	----------	-------

当座預金残高	5,510,000	5,468,100	5,467,600
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,915,500		
積み終了先	4,915,400		
超過準備	4,915,400		
非準備預金先	594,500		
7月3日以降の残り所要積立額			
積数		600	
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	56.67%
---------	----	--------	----	--------

●2024年7月2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、地合いに大きな変化はなく、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズから、出合いの水準は0.07~0.078%程度で推移した。
ターム物は、証券業態の調達を中心にショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.05~0.085%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>

2日のアウトライ市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/7/2	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	0.065	0.078	0.077				-	0.078
T/N							-	0.079
S/N							-	-
1W			0.125				-	0.054
2W			0.165				-	0.051
3W							-	0.051
1M			0.150				-	0.051
3M							0.020	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)
1.100	+0.041	40,074.69	+443.63	161.50-52	161.64-66

日付	6/25	6/26	6/27	6/28	7/1
日銀当預残	5,554,500	5,535,900	5,526,000	5,517,800	5,519,600
準備預金残	4,946,400	4,937,000	4,918,300	4,905,300	4,928,600
マネタリーベース	6,790,000	6,771,500	6,762,000	6,753,900	6,755,200
無担O/N加重平均	0.078%	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%
コール市場残高	119,208	117,424	116,685	115,546	115,548
うち無担	81,627	79,744	79,177	79,425	77,488
うちO/N	35,168	33,545	33,908	39,831	36,517
うち有担	37,581	37,680	37,508	36,121	38,060

●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非償還額(億円)	非償還入札(億円)
10年利付国債	375	1.1%	26,000	2024/7/3	2034/6/20	63,476	19,638	100.06	1.093%	79.8903%	100.08	1.091%	6.342	7.3

●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
米ドル資金供給		2024/7/5	2024/7/11	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/2	2024/7/3	▲ 0.150	31,765	31,765		▲ 0.150	▲ 0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/2	2024/7/3	▲ 0.150	17	17		▲ 0.150	▲ 0.150	

●2024年7月3日の予定

*7月の日銀当座預金増減要因見込み

*5月の米貿易収支
*5月の米製造業新規受注・出荷・在庫
*6月のISM非製造業景況指数

◆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