

# Central Daily Market Report

2024年7月4日(木)

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4日 需給速報	2024年7月5日 需給予想	2024年7月8日 当社予想
銀行券	▲ 3,600	▲ 1,700	▲ 400
財政	1,700	▲ 4,500	5,000

資金過不足	▲ 1,900	▲ 6,200	4,600
-------	---------	---------	-------

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	10,800					
CP等買入				▲ 300		
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	▲ 24,000	25,800		24,000		

当増減	10,700	17,500	4,600
-----	--------	--------	-------

当座預金残高	5,450,600	5,468,100	5,472,700
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,846,700		
--------	-----------	--	--

積み終了先	4,846,600		
-------	-----------	--	--

超過準備	4,846,600		
------	-----------	--	--

非準備預金先	603,900		
--------	---------	--	--

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	99.99%	日数	63.33%
---------	----	--------	----	--------

7月5日以降の残り所要積立額			
----------------	--	--	--

積数			400
----	--	--	-----

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	99.99%	日数	63.33%
---------	----	--------	----	--------

## ●短期金融市場関連指標

2024/7/4	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	0.050	0.079	0.077				-	0.054
T/N							-	0.044
S/N							-	-
1W							-	0.050
2W							-	0.050
3W							-	0.051
1M							-	0.050
3M							0.010	0.085
6M							0.015	0.139
1Y							0.140	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)
1.080	▲ 0.015	40,913.65	+332.89	161.58-60	161.27-29

日付	6/27	6/28	7/1	7/2	7/3
日銀当預残	5,526,000	5,517,800	5,519,600	5,510,000	5,439,900
準備預金残	4,918,300	4,905,300	4,928,600	4,915,500	4,837,900
マネタリーベース	6,762,000	6,753,900	6,755,200	6,744,500	6,689,800
無担O/N加重平均	0.077%	0.076%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	116,685	115,546	115,548	115,583	118,968
うち無担	79,177	79,425	77,488	77,348	79,854
うちO/N	33,908	39,831	36,517	33,977	36,733
うち有担	37,508	36,121	38,060	38,235	39,114

## ●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非価格競争入札(億円)
30年利付国債	83	2.2%	9,000	2024/7/5	2054/6/20	20,220	6,804	100.10	2.194%	74.8819%	100.17	2.190%	2,188

## ●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)		2024/7/4	2024/7/5	▲0.150	24,635	24,635		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/4	2024/7/5	▲0.150	0	0				

## ●2024年7月5日の予定

*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *5月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+0.1%) *5月の景気動向指数速報	*6月の米雇用統計	*国庫短期証券(1241回)入札 (3ヶ月、52,000億円、7/8発行)
---	-----------	--

◆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