Central Daily Market Report

2024年7月5日(金)

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5日 需給速報	2024年7月8日 需給予想	2024年7月9日 当社予想	
銀行券	▲ 1,600	300	500	
財政	5,100	5,600	1,000	
資金過不足	3,500	5,900	1,500	
金融調節	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		▲ 300	▲ 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			▲ 100	
気候変動対応オペ				
E T F買入				
国債補完供給	▲ 22,500	24,000	22,500	
* FDL資金供給用国債補完供給				
当預増減	4,700	28,000	1,500	
当座預金残高	5,455,300	5,483,300	5,484,800	
準備預金残高	4,845,100			
積み終了先	4,845,000		7月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,845,000		積数	200
非準備預金先	610,200		1日平均	0
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額			3,944,900	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	73.33%

●2024年7月5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、週末3日積みとなったが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引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.055~0.085%程度での出合いとなった。
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>

5日はTB3M物(第1241回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小甘く推移した。

<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

2024/7/5	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	0.050	0.078	0.077				-	0.051
T/N							-	0.067
S/N							-	-
1W							-	0.052
2W							-	0.051
3W							-	0.052
1M	0.180	0.230	0.205				-	0.051
3M			0.220				0.010	0.086
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)		
1.065	▲ 0.015	40,912.37	▲ 1.28	161.35-37	160.76-78		
日付	6/28	7/1	7/2	7/3	7/4		
日銀当預残	5,517,800	5,519,600	5,510,000	5,439,900	5,450,600		
準備預金残	4,905,300	4,928,600	4,915,500	4,837,900	4,846,600		
マネタリーベース	6,753,900	6,755,200	6,744,500	6,689,800	6,704,200		
無担O/N加重平均	0.076%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%		
コール市場残高	115,546	115,548	115,583	118,968	120,508		
うち無担	79,425	77,488	77,348	79,854	80,567		
うちO/N	39,831	36,517	33,977	36,733	38,156		
うち有担	36,121	38,060	38,235	39,114	39,941		

●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)
国庫短期証券	1241	-	52,000	2024/7/8	2024/10/7	137,058.3	39,515.7	99.9980	0.0080%	77.9074%	99.9992	0.0032%	12,484

●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	応募総額(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)		2024/7/5	2024/7/8	▲0.250	23,084	23,084		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/5	2024/7/8	▲0.250	0	0				

●2024年7月8日の予定

*日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)	*5月の米消費者信用残高
*5月の国際収支	
*5月の毎月勤労統計調査速報	
*6月の景気ウォッチャー調査	

◆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