

Central Daily Market Report

2024年7月8日(月)
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8日 需給速報		2024年7月9日 需給予想		2024年7月10日 当社予想	
銀行券	400		600		500	
財政	3,100		1,100		▲ 21,000	
資金過不足	3,500		1,700		▲ 20,500	
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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
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		▲ 100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 22,400	22,500		22,400		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	3,200		24,100		▲ 28,500	
当座預金残高	5,458,500		5,482,600		5,454,100	
準備預金残高	4,849,500					
積み終了先	4,849,400				7月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,849,400				積数	200
非準備預金先	609,000				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	76.67%	

●2024年7月8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無く、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズを背景に、出合いの水準は0.075～0.078%程度で推移した。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.05～0.075%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＞

8日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態で発行が実施された。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

2024/7/8	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	0.060	0.078	0.077				－	0.087
T/N							－	0.058
S/N							－	－
1W							－	0.051
2W			0.190				－	0.051
3W							－	0.051
1M							－	0.051
3M			0.210				0.010	0.087
6M							0.050	0.140
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)
1.085	+0.020	40,780.70	▲ 131.67	160.64-66	160.90-91
日付					
7/1	7/2	7/3	7/4	7/5	
日銀当預残	5,519,600	5,510,000	5,439,900	5,450,600	5,455,300
準備預金残	4,928,600	4,915,500	4,837,900	4,846,600	4,845,100
マネタリーベース	6,755,200	6,744,500	6,689,800	6,704,200	6,710,500
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	115,548	115,583	118,968	120,508	121,554
うち無担	77,488	77,348	79,854	80,567	81,633
うちO/N	36,517	33,977	36,733	38,156	39,139
うち有担	38,060	38,235	39,114	39,941	39,921

●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)		2024/7/8	2024/7/9	▲0.150	23,003	23,003		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/8	2024/7/9	▲0.150	0	0				

●2024年7月9日の予定

*6月のマネーストック *5月の特定サービス産業動態統計速報	*国庫短期証券(1242回)入札 (6ヶ月、37,000億円、7/10発行) *5年利付国債入札 (23,000億円、7/10発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、7/18借入)
◆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	