

# Central Daily Market Report

2024年7月9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9日 需給速報	2024年7月10日 需給予想	2024年7月11日 当社予想
銀行券	800	1,100	500
財政	2,200	▲ 25,000	▲ 2,000
資金過不足	3,000	▲ 23,900	▲ 1,500

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	▲ 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					▲ 700		
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)							
被災地支援							
社債等買入					▲ 300		
気候変動対応オペ							
E T F買入							
国債補完供給	▲ 22,300	22,400		22,300			
当預増減		3,100		▲ 2,600		▲ 1,500	

当座預金残高	5,461,600	5,459,000	5,457,500	
準備預金残高	4,855,800			
積み終了先	4,855,700			
超過準備	4,855,700			
非準備預金先	605,800			
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	80.00%

## ●短期金融市場関連指標

2024/7/9	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	0.055	0.125	0.077				-	0.054
T/N							-	0.069
S/N							-	-
1W							-	0.054
2W							-	0.052
3W							-	0.053
1M							-	0.053
3M							0.010	0.088
6M							0.020	0.142
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)
1.070	▲ 0.015	41,580.17	+799.47	160.85-87	160.91-92

  

日付	7/2	7/3	7/4	7/5	7/8
日銀当預残	5,510,000	5,439,900	5,450,600	5,455,300	5,458,500
準備預金残	4,915,500	4,837,900	4,846,600	4,845,100	4,849,500
マネタリーベース	6,744,500	6,689,800	6,704,200	6,710,500	6,713,300
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	115,583	118,968	120,508	121,554	120,746
うち無担	77,348	79,854	80,567	81,633	79,734
うちO/N	33,977	36,733	38,156	39,139	37,600
うち有担	38,235	39,114	39,941	39,921	41,012

## ●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1242	-	37,000	2024/7/10	2025/1/10	103,641.2	28,121.8	99.976	0.0476%	31.3193%	99.980	0.0396%	8,878	
5年利付国債	170	0.6%	23,000	2024/7/10	2029/6/20	74,342	17,468	99.93	0.614%	64.5510%	99.94	0.612%	5,514	10.5
交付税特会	-	-	13,000	2024/7/18	2025/1/16	64,055	12,990		0.230%	8.9544%		0.205%		10

## ●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
米ドル資金供給		2024/7/11	2024/7/18	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/9	2024/7/10	▲0.150	22,905	22,905		▲0.150	▲0.150	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/7/10	2024/7/24	0.100	9,276	8,005				86.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/9	2024/7/10	▲0.150	0	0				

## ●2024年7月10日の予定

*6月の企業物価指数	*5月の米卸売売上高
------------	------------

◆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

## ●2024年7月9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、調達サイドの一部に目線を引き下げる動きがあったものの、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズがあったことから、出合いの水準は0.075~0.078%程度と前営業日と同水準で推移した。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.065~0.10%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>

9日はTBGM物(第1242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、堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。