

Central Daily Market Report

2024年7月10日(水)

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10日 需給速報	2024年7月11日 需給予想	2024年7月12日 当社予想
銀行券	1,100	900	▲1,000
財政	▲18,400	▲9,400	▲3,000
資金過不足	▲17,300	▲8,500	▲4,000

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	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			12,900					
国債買入								
CP等買入		▲700		▲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		▲300		▲100				
気候変動対応オペ								
E T F買入								
国債補完供給	▲21,800	22,300		21,800				
当預増減	▲17,800		25,800		▲4,000			

当座預金残高	5,443,800	5,469,600	5,465,600	
準備預金残高	4,834,000			
積み終了先	4,833,900		7月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,833,900		積数	100
非準備預金先	609,800		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	100.00%	日数	83.33%

●2024年7月10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から、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、0.07~0.09%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>

10日のアウトライイト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、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。

●短期金融市場関連指標

2024/7/10	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	0.150	0.077				-	0.083
T/N							-	0.076
S/N							-	-
1W			0.075				-	0.055
2W			0.210				-	0.054
3W	0.150	0.170	0.157				-	0.056
1M			0.165				-	0.056
3M							0.010	0.089
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)
1.085	+0.015	41,831.99	+251.82	161.32-34	161.49-51
日付	7/3	7/4	7/5	7/8	7/9
日銀当預残	5,439,900	5,450,600	5,455,300	5,458,500	5,461,600
準備預金残	4,837,900	4,846,600	4,845,100	4,849,500	4,855,300
マネタリーベース	6,689,800	6,704,200	6,710,500	6,713,300	6,715,700
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	118,968	120,508	121,554	120,746	120,841
うち無担	79,854	80,567	81,633	79,734	79,797
うちO/N	36,733	38,156	39,139	37,600	37,363
うち有担	39,114	39,941	39,921	41,012	41,044

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/7/11			9,504	3,752	▲0.018		▲0.011	5.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/7/11			8,096	4,252	▲0.013		▲0.006	29.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/7/11			9,267	4,257	0.010		0.012	84.2
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/7/11			2,120	753	0.025		0.030	49.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/10	2024/7/11	▲0.150	22,413	22,413		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/10	2024/7/11	▲0.150	1	1		▲0.150	▲0.150	

●2024年7月11日の予定

*5月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+0.8%)	*6月の米消費者物価指数 *6月の米財政収支	*20年利付国債入札 (10,000億円、7/12発行) *エネルギー対策借入 (7,957億円、7/22借入)
◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されていますが、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		