

Central Daily Market Report

2024年7月11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11日 需給速報	2024年7月12日 需給予想	2024年7月16日 当社予想	
銀行券	800	800	2,000	
財政	▲ 10,200	▲ 20,000	4,000	
資金過不足	▲ 9,400	▲ 19,200	6,000	
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	12,900			
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	▲ 100	
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 21,000	21,800	21,000	
※ドル資金供給用信託国債供給				
当預増減	3,900	1,700	6,000	
当座預金残高	5,447,700	5,449,400	5,455,400	
準備預金残高	4,847,400			
積み終了先	4,847,300		7月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,847,300		積数	100
非準備預金先	600,300		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	86.67%

●2024年7月11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、0.05～0.09%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＞

11日のアウトラ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、一部大型発行も見られた。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。
CP買入オペが予定通りオファー額3,000億円で実施されたが、結果は 按分レート0.191%、平均レート0.200%と前回(按分0.167%、平均0.184%)比で、按分レート、平均レート共に上昇した。

●短期金融市場関連指標

2024/7/11	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	0.070	0.079	0.077				－	0.079
T/N							－	0.053
S/N							－	－
1W			0.240				－	0.053
2W	0.140	0.170	0.152				－	0.053
3W							－	0.054
1M							－	0.055
3M	0.230	0.240	0.237				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)
1.080	▲ 0.005	42,224.02	+392.03	161.57-59	161.62-64
日付	7/4	7/5	7/8	7/9	7/10
日銀当預残	5,450,600	5,455,300	5,458,500	5,461,600	5,443,800
準備預金残	4,846,600	4,845,100	4,849,500	4,855,300	4,834,000
マネタリーベース	6,704,200	6,710,500	6,713,300	6,715,700	6,696,700
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	120,508	121,554	120,746	120,841	113,838
うち無担	80,567	81,633	79,734	79,797	72,696
うちO/N	38,156	39,139	37,600	37,363	30,872
うち有担	39,941	39,921	41,012	41,044	41,142

●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)
20年利付国債	189	1.9%	10,000	2024/7/12	2044/6/20	28,721	7,555	99.75	1.917%	55.5834%	99.80	1.913%	2,436
エネルギー対策	－	－	7,957	2024/7/22	2025/7/22	42,489	7,957		0.329%	53.5434%		0.310%	

●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
CP等買入	3,000	2024/7/17			8,404	2,994	0.191		0.200	26.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/11	2024/7/12	▲ 0.150	21,481	21,481		▲ 0.150	▲ 0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/11	2024/7/12	▲ 0.150	41	41		▲ 0.150	▲ 0.150	

●2024年7月12日の予定

*6月の米生産者物価指数	*国庫短期証券(1243回)入札 (3ヶ月、52,000億円、7/16発行)
*7月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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ものがあります。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