

Central Daily Market Report

2024年7月12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12日 需給速報		2024年7月16日 需給予想		2024年7月17日 当社予想							
銀行券	900		1,100		2,000							
財政	▲ 20,300		▲ 31,700		▲ 6,000							
資金過不足	▲ 19,400		▲ 30,600		▲ 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						
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	3,000							
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	▲ 20,700	21,000		20,700								
※ドル資金供給用国債提供供給												
当預増減	▲ 19,200		▲ 10,200		▲ 1,000							
当座預金残高	5,428,500		5,418,300		5,417,300							
準備預金残高	4,830,300		<table><tr><td colspan="2">7月16日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>4,082,100</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>131,700</td></tr></table>				7月16日以降の残り所要積立額		積数	4,082,100	1日平均	131,700
7月16日以降の残り所要積立額												
積数	4,082,100											
1日平均	131,700											
積み終了先	4,830,300											
超過準備	4,830,300											
非準備預金先	598,200											
積み期間（7/16～8/15）の所要準備額					4,082,100							
準備預金進捗率	実績		0.00%		日数	0.00%						

●2024年7月12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、積み最終日までの4日積みではあったものの、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、0.075～0.085%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＞

12日はTB3M物（第1243回）の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりの推移となった。この他、1Y物でも出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/7/12	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				－	0.086
T/N							－	0.080
S/N							－	－
1W							－	0.057
2W			0.150				－	0.054
3W							－	0.055
1M			0.190				－	0.055
3M							0.015	0.088
6M							0.020	0.142
1Y							0.170	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）
1.045	▲ 0.035	41,190.68	▲ 1033.34	158.24～29	159.21～23
日付	7/5	7/8	7/9	7/10	7/11
日銀当預残	5,455,300	5,458,500	5,461,600	5,443,800	5,447,700
準備預金残	4,845,100	4,849,500	4,855,300	4,834,000	4,847,400
マネタリーベース	6,710,500	6,713,300	6,715,700	6,696,700	6,699,700
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	121,554	120,746	120,841	113,838	115,683
うち無担	81,633	79,734	79,797	72,696	75,402
	うちO/N	39,139	37,600	37,363	30,872
	うち有担	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）
国庫短期証券	1243	－	52,000	2024/7/16	2024/10/15	138,775	39,522.6	99.9955	0.0180%	25.1779%	99.9967	0.0132%	12,477

●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（午前オフアー分）		2024/7/12	2024/7/16	▲0.150	21,271	21,271		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オフアー分）		2024/7/12	2024/7/16	▲0.150	0	0				

●2024年7月15日の予定

*海の日

●2024年7月16日の予定

*5月の第3次産業活動指数	*6月の米小売売上高 *5月の米企業在庫	*流動性供給入札 （6,000億円、7/17発行）
---------------	-------------------------	------------------------------

◆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