

Central Daily Market Report

2024年7月16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16日 需給速報	2024年7月17日 需給予想	2024年7月18日 当社予想
銀行券	1,000	1,400	2,000
財政	▲ 29,600	▲ 27,400	10,000
資金過不足	▲ 28,600	▲ 26,000	12,000

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	国債買入	CP等買入	貸出支援基金(成)	貸出支援基金(貸)
貸出								
全店共通								
国債買現								
国債売現								
国債買入								
CP等買入			▲ 300	3,000	▲ 100			
貸出支援基金(成)								
貸出支援基金(貸)								
被災地支援								
社債等買入								
気候変動対応オペ								
E T F 買入								
国債補完供給	▲ 22,700	20,700		22,700				
当預増減	▲ 30,900		▲ 400					12,000

当座預金残高	5,397,600	5,397,200	5,409,200	
準備預金残高	4,810,100			
積み終了先	3,490,100			
超過準備	1,296,900			
非準備預金先	587,500			
7月17日以降の残り所要積立額				
積数		568,900		
1日平均		19,000		
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	86.06%	日数	3.23%

●2024年7月16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、新積初日となったことで資金調達サイドでニーズがみられる先が増えることとなったが、レート水準については大きく変化することなく、0.075~0.078%程度で横ばい推移となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.065~0.07%程度での出会いとなった。
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>

16日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<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

2024/7/16	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	0.050	0.079	0.077				-	0.081
T/N							-	0.052
S/N							-	-
1W	0.150	0.175	0.167				-	0.056
2W	0.110	0.300	0.149				-	0.055
3W			0.130				-	0.055
1M							-	0.056
3M	0.210	0.290	0.260				0.015	0.089
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)
1.020	▲ 0.025		41,275.08	+84.40		158.15-17	158.49-51
日付	7/8	7/9	7/10	7/11	7/12		
日銀当預残	5,458,500	5,461,600	5,443,800	5,447,700	5,428,500		
準備預金残	4,849,500	4,855,300	4,834,000	4,847,400	4,830,700		
マネタリーベース	6,713,300	6,715,700	6,696,700	6,699,700	6,679,700		
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	120,746	120,841	113,838	115,683	114,954		
うち無担	79,734	79,797	72,696	75,402	75,197		
うちO/N	37,600	37,363	30,872	33,458	31,520		
うち有担	41,012	41,044	41,142	40,281	39,757		

●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)
流動性供給	409	-	6,000	2024/7/17	-	20,546	5,994		▲0.029%	48.2789%		▲0.031%	

●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		2024/7/18	2024/7/25	5.580	3	3				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/16	2024/7/17	▲ 0.150	23,305	23,305		▲ 0.150	▲ 0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/16	2024/7/17	▲ 0.150	0	0				

●2024年7月17日の予定

*米ページブック	*6月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*交付税特別会計借入
*6月の米住宅着工件数	*6月の英消費者物価指数	(13,000億円、7/25借入)
*6月の米鉱工業生産・設備稼働率		

◆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