

●資金需給

単位：億円	2024年7月17日 需給速報		2024年7月18日 需給予想		2024年7月19日 当社予想							
銀行券	1,500		700		1,500							
財政	▲ 23,500		9,000		▲ 4,000							
資金過不足	▲ 22,000		9,700		▲ 2,500							
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												
国債買現												
国債売現												
国庫短期証買入												
国債買入			9,600									
CP等買入	3,000	▲ 100		▲ 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						▲ 34,400						
E T F 買入												
国債補完供給	▲ 25,600	22,700		25,600								
※ FDL資金供給用国債提供供給												
当預増減	▲ 22,000		44,800		▲ 36,900							
当座預金残高	5,375,600		5,420,400		5,383,500							
準備預金残高	4,785,300		<table><tr><td colspan="2">7月18日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>82.500</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>2,800</td></tr></table>				7月18日以降の残り所要積立額		積数	82.500	1日平均	2,800
7月18日以降の残り所要積立額												
積数	82.500											
1日平均	2,800											
積み終了先	4,712,900											
超過準備	4,298,800											
非準備預金先	590,300											
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 97.98%		日数		6.45%							

●2024年7月17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、引き続き邦銀業態からの資金調達ニーズが強く、レート水準についても0.075~0.078%程度で横ばい推移となった。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.01~0.05%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＞
17日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞
CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2024/7/17	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	0.078				-	0.079
T/N							-	0.041
S/N							-	-
1W	0.075	0.175	0.082				-	0.051
2W			0.180				-	0.053
3W							-	0.055
1M							-	0.056
3M							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)
1.030	+0.010	41,097.69	▲ 177.39	158.34-37	157.07-09

日付	7/9	7/10	7/11	7/12	7/16
日銀当預残	5,461,600	5,443,800	5,447,700	5,428,500	5,397,600
準備預金残	4,855,300	4,834,000	4,847,400	4,830,700	4,810,100
マネタリーベース	6,715,700	6,696,700	6,699,700	6,679,700	6,647,700
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	120,841	113,838	115,683	114,954	118,547
うち無担	79,797	72,696	75,402	75,197	78,974
うちO/N	37,363	30,872	33,458	31,520	34,562
うち有担	41,044	41,142	40,281	39,757	39,573

●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非面 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
交付税特会	-	-	13,000	2024/7/25	2025/1/24	61,834	12,990		0.220%	60.4324%		0.206%		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	2024/7/18			12,722	3,755	▲0.009		▲0.008	90.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/7/18			7,590	4,257	▲0.015		▲0.012	56.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/7/18			2,075	1,501	▲0.014		▲0.008	86.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/17	2024/7/18	▲0.150	26,309	26,309		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/17	2024/7/18	▲0.150	0	0				

●2024年7月18日の予定

*6月の貿易統計 *5月の石油等消費動態統計	*ECB定例理事会	*国庫短期証券(1244回)入札 (1年、32,000億円、7/22発行) *GX5年利付国債入札 (3,500億円、7/19発行)
---------------------------	-----------	---

◆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ことがあります。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