

●資金需給

単位：億円	2024年7月18日 需給速報		2024年7月19日 需給予想		2024年7月22日 当社予想	
銀行券	800		1,200		2,000	
財政	7,100		5,900		9,000	
資金過不足	7,900		7,100		11,000	
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	9,600					
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 500		
気候変動対応オペ			72,400	▲ 34,400		
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 23,300	25,600		23,300		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	19,700		67,700		11,000	
当座預金残高	5,395,300		5,463,000		5,474,000	
準備預金残高	4,805,100					
積み終了先	4,770,900				7月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,757,300				積数 34,700	
非準備預金先	590,200				1日平均 1,200	
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 99.15%		日数		9.68%	

●2024年7月18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、▲0.02～0.03%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＞
18日はTB1Y物(第1244回)の入札が実施され、やや強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりで推移した。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数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

2024/7/18	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	0.079	0.077				－	0.033
T/N							－	▲ 0.033
S/N							－	－
1W			0.150				－	0.044
2W			0.160				－	0.049
3W							－	0.053
1M	0.150	0.215	0.172				－	0.055
3M							0.015	0.090
6M							0.020	0.142
1Y							0.165	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)
1.035	+0.005	40,126.35	▲ 971.34	155.67-69	156.24-26

日付	7/10	7/11	7/12	7/16	7/17
日銀当預残	5,443,800	5,447,700	5,428,500	5,397,600	5,375,600
準備預金残	4,834,000	4,847,400	4,830,700	4,810,100	4,785,500
マネタリーベース	6,696,700	6,699,700	6,679,700	6,647,700	6,624,300
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.078%
コール市場残高	113,838	115,683	114,954	118,547	120,095
うち無担	72,696	75,402	75,197	78,974	80,798
うちO/N	30,872	33,458	31,520	34,562	36,076
うち有担	41,142	40,281	39,757	39,573	39,297

●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	1244	－	32,000	2024/7/22	2025/7/22	96,056	24,355.7	99.821	0.1793%	19.7996%	99.833	0.1672%	7,644
GX5年利付国債	2	0.5%	3,500	2024/7/19	2029/6/20	14,117	3,496	99.54	0.595%	55.0000%			

●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(午前オファー分)		2024/7/18	2024/7/19	▲0.250	23,848	23,848		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/18	2024/7/19	▲0.250	6	6		▲0.250	▲0.250	

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
気候変動対応支援オペ	2024/7/19	2025/7/18	0.1	72,361

●2024年7月19日の予定

*6月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.7%)	*国庫短期証券(1245回)入札 (3ヶ月、52,000億円、7/22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