

Central Daily Market Report

2024年7月3日(水)

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3日 需給速報	2024年7月4日 需給予想	2024年7月5日 当社予想			
銀行券	▲ 15,400	▲ 3,600	▲ 2,000			
財政	▲ 59,900	1,000	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 75,300	▲ 2,600	▲ 9,000			
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			10,800			
CP等買入						
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	▲ 25,800	31,000		25,800		
当預増減	▲ 70,100		34,000		▲ 9,000	
当預現金残高	5,439,900		5,473,900		5,464,900	
準備預金残高	4,837,900					
積み終了先	4,837,800			7月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,837,800			積数	500	
非準備預金先	602,000			1日平均	0	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,942,000	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	60.00%		

●2024年7月3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なく、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0.07~0.078%程度で推移した。
ターム物は、証券業態の調達を中心にショートタームでの引き合いが見られた。
新紙幣の発行により銀行券要因は大幅な発行超となったが、コール市場への影響はほとんど見られなかった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.05~0.065%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>

3日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、6M物で少額の出合いが見られた。

<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

2024/7/3	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート
	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	0.078	0.077				-	0.047
T/N							-	0.051
S/N							-	-
1W	0.240	0.250	0.248				-	0.051
2W							-	0.051
3W							-	0.051
1M							-	0.051
3M							0.019	0.084
6M							0.015	0.139
1Y							0.150	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)
1.095	▲ 0.005	40,580.76	+506.07	161.49-51	161.75-78
日付	6/26	6/27	6/28	7/1	7/2
日銀当預残	5,535,900	5,526,000	5,517,800	5,519,600	5,510,000
準備預金残	4,937,000	4,918,300	4,905,300	4,928,600	4,915,500
マネタリーベース	6,771,500	6,762,000	6,753,900	6,755,200	6,744,500
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%	0.077%
コール市場残高	117,424	116,685	115,546	115,548	115,583
うち無担	79,744	79,177	79,425	77,488	77,348
うちO/N	33,545	33,908	39,831	36,517	33,977
うち有担	37,680	37,508	36,121	38,060	38,235

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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年以下)	1,500	2024/7/4			4,262	1,500	▲0.010		0.005	0.1
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/7/4			11,320	3,754	▲0.014		▲0.010	19.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/7/4			8,045	4,255	▲0.019		▲0.015	84.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/7/4			3,908	1,504	0.007		0.010	67.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/7/3	2024/7/4	▲0.150	26,568	26,568		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/7/3	2024/7/4	▲0.150	0	0				

●2024年7月4日の予定

*New York祝日(Independence Day)	*30年利付国債入札(9,000億円、7/5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