

Central Daily Market Report

2024年6月3日(月)

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6月3日 需給速報		2024年6月4日 需給予想		2024年6月5日 当社予想	
銀行券	900		900		700	
財政	▲ 67,700		▲ 36,800		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 66,800		▲ 35,900		▲ 25,300	
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	10,900					
CP等買入						
貸出支援基金(成)		▲ 1,600				
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	▲ 28,600	27,800		28,600		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 58,400		▲ 7,300		▲ 25,300	
当座預金残高	5,456,900		5,449,600		5,424,300	
準備預金残高	4,823,600		6月4日以降の残り所要積立額 積数 2,300 1日平均 200			
積み終了先	4,822,600					
超過準備	4,822,600					
非準備預金先	633,300					
積み期間（5/16～6/15）の所要準備額					4,079,800	
準備預金進捗率	実績 99.94%		日数 61.29%			

●短期金融市場関連指標

2024/6/3	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	売買参考値	平均値
O/N	0.070	0.078	0.077				-	0.086
T/N							-	0.069
S/N							-	-
1W							-	0.059
2W			0.150				-	0.059
3W							-	0.059
1M			0.230				-	0.058
3M							0.030	0.086
6M							0.060	0.130
1Y							0.205	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)
1.060	▲ 0.010	38,923.03	+435.13	157.18-20	157.11-13
日付	5/27	5/28	5/29	5/30	5/31
日銀当預残	5,524,600	5,533,800	5,523,300	5,521,200	5,515,300
準備預金残	4,885,600	4,877,600	4,877,900	4,867,600	4,848,000
マネタリーベース	6,768,300	6,777,000	6,766,200	6,763,500	6,757,200
無担O/N加重平均	0.078%	0.077%	0.078%	0.077%	0.077%
コール市場残高	114,703	113,656	116,555	115,755	121,602
うち無担	75,707	74,804	76,749	76,284	83,324
うちO/N	32,154	31,234	33,079	32,344	38,974
うち有担	38,996	38,852	39,806	39,471	38,278

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/3	2024/6/4	▲0.150	29,555	29,555		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/3	2024/6/4	▲0.150	0	0				

●2024年6月4日の予定

*5月のマネタリーベース	*4月の米製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札 (26,000億円、6/5発行)
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み		

◆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