

Central Daily Market Report

2024年6月5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6月5日 需給速報	2024年6月6日 需給予想	2024年6月7日 当社予想			
銀行券	500	400	500			
財政	▲ 26,200	700	▲ 9,000			
資金過不足	▲ 25,700	1,100	▲ 8,500			
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						
CP等買入		▲ 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	▲ 35,400	35,900		35,400		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 25,300		36,500		▲ 8,500	
当座預金残高	5,384,000		5,420,500		5,412,000	
準備預金残高	4,741,900					
積み終了先	4,741,900				6月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,741,100				積数	600
非準備預金先	642,100				1日平均	100
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	99.99%	日数	67.74%		

●2024年6月5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、引き続き邦銀業態を中心に堅調な資金調達ニーズが見られており、出合いの水準は0.07～0.078%程度と横ばい圏で推移した。
ターム物は、目立った出合いがなく閑散であった。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.07～0.08%程度での出合いとなった。
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＞
5日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物と1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2024/6/5	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				－	0.079
T/N							－	0.069
S/N							－	－
1W							－	0.061
2W							－	0.059
3W			0.190				－	0.058
1M			0.240				－	0.058
3M							0.030	0.087
6M							0.060	0.133
1Y							0.205	0.201

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）
1.000	▲ 0.030	38,490.17	▲ 347.29	155.10-12	156.14-15

日付	5/29	5/30	5/31	6/3	6/4
日銀当預残	5,523,300	5,521,200	5,515,300	5,456,900	5,409,300
準備預金残	4,877,900	4,867,600	4,848,000	4,823,600	4,771,500
マネタリーベース	6,766,200	6,763,500	6,757,200	6,697,900	6,649,400
無担O/N加重平均	0.078%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	116,555	115,755	121,602	116,471	119,124
うち無担	76,749	76,284	83,324	78,190	80,530
うちO/N	33,079	32,344	38,974	33,560	35,300
うち有担	39,806	39,471	38,278	38,281	38,594

●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（午前オフア分）		2024/6/5	2024/6/6	▲0.150	36,449	36,449		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オフア分）		2024/6/5	2024/6/6	▲0.150	0	0				

●2024年6月6日の予定

*札幌市金融経済懇談会において 中村日銀審議委員講演	*ECB定例理事会 *4月の米貿易収支	*国庫短期証券（1235回）入札 （6か月、37,000億円、6/10発行） *30年利付国債入札 （9,000億円、6/7発行） *交付税特別会計借入 （13,000億円、6/14借入）
◆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		