

Central Daily Market Report

2024年6月6日 (木)
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6日 需給速報		2024年6月7日 需給予想		2024年6月10日 当社予想	
銀行券	400		600		500	
財政	1,800		▲ 700		9,000	
資金過不足	2,200		▲ 100		9,500	
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				▲ 600		
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	▲ 34,500	35,400		34,500		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	3,100		33,800		9,500	
当座預金残高	5,387,100		5,420,900		5,430,400	
準備預金残高	4,739,900					
積み終了先	4,739,900				6月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,739,900				積数 500	
非準備預金先	647,200				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		70.97%	

●2024年6月6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、ショートターム物で引き合いが見られた。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、▲0.005~0.07%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＞
6日はTB6M物(第1235回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

＜CP市場＞
CP発行市場は複数の発行が観測され、一部大型発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/6/6	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	0.078	0.077				-	0.079
T/N							-	0.056
S/N							-	-
1W							-	0.059
2W							-	0.058
3W							-	0.058
1M	0.200	0.230	0.220				-	0.058
3M							0.030	0.086
6M							0.045	0.133
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)
0.955	▲ 0.045	38,703.51	+213.34	155.90~92	156.27~29

日付	5/30	5/31	6/3	6/4	6/5
日銀当預残	5,521,200	5,515,300	5,456,900	5,409,300	5,384,000
準備預金残	4,867,600	4,848,000	4,823,600	4,771,500	4,741,900
マネタリーベース	6,763,500	6,757,200	6,697,900	6,649,400	6,623,500
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	115,755	121,602	116,471	119,124	119,012
うち無担	76,284	83,324	78,190	80,530	80,023
うちO/N	32,344	38,974	33,560	35,300	34,113
うち有担	39,471	38,278	38,281	38,594	38,989

●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非備 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
国庫短期証券	1235	-	37,000	2024/6/10	2024/12/10	118,556	28,121.6	99.956	0.0877%	99.7854%	99.957	0.0858%	8,878	
30年利付国債	82	1.8%	9,000	2024/6/7	2054/3/20	24,437	6,805	93.45	2.161%	64.5739%	93.54	2.156%	2,188	
交付税特会	-	-	13,000	2024/6/14	2024/12/13	64,609	12,990		0.220%	6.4870%		0.194%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/6	2024/6/7	▲0.150	35,390	35,390		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/6	2024/6/7	▲0.150	0	0				

●2024年6月7日の予定

*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *4月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比+0.6%) *4月の景気動向指数速報	*5月の米雇用統計 *4月の米卸売売上高 *4月の米消費者信用残高 *1~3月期のユーロ圏GDP確報値	*国庫短期証券(1236回)入札 (3ヶ月、55,000億円、6/10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