

Central Daily Market Report

2024年6月18日(火)

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18日 需給速報	2024年6月19日 需給予想	2024年6月20日 当社予想
銀行券	700	▲ 400	▲ 500
財政	5,500	100	70,000
資金過不足	6,200	▲ 300	69,500

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			13,500			
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			67,600	▲ 60,000		
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	▲ 31,600	31,400		31,600		

当預増減	5,900	52,400	69,500	
当座預金残高	5,488,900	5,541,300	5,610,800	
準備預金残高	4,854,800			
積み終了先	4,828,700			
超過準備	4,811,100			
非準備預金先	634,100			
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	99.21%	日数	10.00%

●2024年6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、地合いに大きな変化は無く、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、ショートターム物での引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.03~0.055%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>

18日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<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

2024/6/18	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	0.040	0.080	0.077				-	0.072
T/N							-	0.045
S/N							-	-
1W			0.125				-	0.045
2W							-	0.044
3W							-	0.045
1M	0.195	0.230	0.222				-	0.042
3M	0.190	0.210	0.197				0.000	0.083
6M							0.010	0.137
1Y							0.160	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)
0.940	+0.015		38,482.11	+379.67		157.69-71	158.13-14
日付	6/11	6/12	6/13	6/14	6/17		
日銀当預残	5,395,300	5,390,900	5,396,300	5,478,600	5,483,000		
準備預金残	4,758,700	4,743,000	4,755,400	4,828,200	4,844,200		
マネタリーベース	6,632,900	6,627,900	6,633,400	6,715,100	6,718,800		
無担O/N加重平均	0.078%	0.078%	0.077%	0.077%	0.077%		
コール市場残高	117,067	115,142	116,797	115,510	120,391		
うち無担	79,219	76,649	77,443	76,746	81,043		
うちO/N	33,159	30,689	31,413	31,306	34,573		
うち有担	37,848	38,493	39,354	38,764	39,348		

●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	応募総額(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年超3年以下)	3,750	2024/6/19			8,851	3,751	▲0.007		0.001	4.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/6/19			8,968	4,253	0.000		0.002	52.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/6/19			11,996	4,256	0.012		0.014	35.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/6/19			3,627	1,502	0.037		0.041	98.8
米ドル資金供給		2024/6/21	2024/6/27	5.580	1	1				
社債等買入	750	2024/6/21			1,531	750	0.503		0.518	52.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/18	2024/6/19	▲0.150	32,318	32,318		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/18	2024/6/19	▲0.150	0	0				

●2024年6月19日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(4月25・26日分)	*5月の英消費者物価指数	*国庫短期証券(1238回)入札
*5月の貿易統計	*New York祝日(Juneteenth National Independence Day)	(1年、32,000億円、6/20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