

Central Daily Market Report

2024年6月19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19日 需給速報		2024年6月20日 需給予想		2024年6月21日 当社予想					
銀行券	▲ 400		▲ 300		▲ 500					
財政	200		60,000		▲ 23,000					
資金過不足	▲ 200		59,700		▲ 23,500					
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										
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				▲ 600	800					
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 31,700	31,600		31,700						
※ F T L 資金供給用国債国債供給										
当預増減	20,800		90,800		▲ 22,700					
当座預金残高	5,509,700		5,600,500		5,577,800					
準備預金残高	4,870,800		6月20日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>17,700</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>700</td></tr></table>				積数	17,700	1日平均	700
積数	17,700									
1日平均	700									
積み終了先	4,862,700									
超過準備	4,857,300									
非準備預金先	638,900									
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	99.55%	日数	13.33%						

●短期金融市場関連指標

2024/6/19	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	0.045	0.079	0.077				-	0.041
T/N							-	0.058
S/N							-	-
1W	0.190	0.350	0.227				-	0.046
2W							-	0.042
3W			0.190				-	0.044
1M			0.215				-	0.044
3M							0.000	0.084
6M							0.010	0.138
1Y							0.125	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)
0.930	▲ 0.010	38,570.76	+88.65	157.87-89	157.74-75
日付	6/12	6/13	6/14	6/17	6/18
日銀当預残	5,390,900	5,396,300	5,478,600	5,483,000	5,488,900
準備預金残	4,743,000	4,755,400	4,828,200	4,844,200	4,854,800
マネタリーベース	6,627,900	6,633,400	6,715,100	6,718,800	6,724,100
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	115,142	116,797	115,510	120,391	121,296
うち無担	76,649	77,443	76,746	81,043	82,403
うちO/N	30,689	31,413	31,306	34,573	35,306
うち有担	38,493	39,354	38,764	39,348	38,893

●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I非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	1238	-	32,000	2024/6/20	2025/6/20	113,708	24,174	99.851	0.1492%	7.0000%	99.861	0.1391%	7,826

●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)		2024/6/19	2024/6/20	▲0.250	32,314	32,314		▲0.250	▲0.251	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/19	2024/6/20	▲0.250	129	129		▲0.250	▲0.250	

●2024年6月20日の予定

*月例経済報告	*英中銀MPC *5月の米住宅着工件数	*5年利付国債入札 (23,000億円、6/21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