

# Central Daily Market Report

2024年6月20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20日 需給速報	2024年6月21日 需給予想	2024年6月24日 当社予想
銀行券	▲ 400	300	▲ 500
財政	59,600	▲ 27,700	6,000
資金過不足	59,200	▲ 27,400	5,500

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		▲ 600	800	▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 29,100	31,700		29,100		
※ドル資金供給用国債補完供給						
当預増減		61,200		2,200		5,500

当座預金残高	5,570,900	5,573,100	5,578,600	
準備預金残高	4,926,800			
積み終了先	4,924,100			
超過準備	4,922,700			
非準備預金先	644,100			
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	99.65%	日数	16.67%

## ●2024年6月20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、0.07~0.09%程度での出合いとなった。SCI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>

20日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、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

2024/6/20	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				-	0.068
T/N							-	0.076
S/N							-	-
1W				0.150			-	0.049
2W							-	0.044
3W							-	0.046
1M				0.280			-	0.050
3M							0.000	0.083
6M				0.370			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)
0.950	+0.020		38,633.02	+62.26		157.95-98	158.27-28
日付	6/13	6/14	6/17	6/18	6/19		
日銀当預残	5,396,300	5,478,600	5,483,000	5,488,900	5,509,700		
準備預金残	4,755,400	4,828,200	4,844,200	4,854,800	4,870,800		
マネタリーベース	6,633,400	6,715,100	6,718,800	6,724,100	6,745,200		
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	116,797	115,510	120,391	121,296	120,588		
うち無担	77,443	76,746	81,043	82,403	81,552		
うちO/N	31,413	31,306	34,573	35,306	34,525		
うち有担	39,354	38,764	39,348	38,893	39,036		

## ●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非償格募入札(億円)	非償募入札(億円)
5年利付国債	169	0.5%	23,000	2024/6/21	2029/3/20	69,314	17,453	99.92	0.517%	35.3407%	99.94	0.512%	5,530	11

## ●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)		2024/6/20	2024/6/21	▲0.150	29,315	29,315		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/20	2024/6/21	▲0.150	400	400		▲0.150	▲0.150	

## ●2024年6月21日の予定

*5月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.6%)	*5月の米中古住宅販売件数	*国庫短期証券(1239回)入札 (3ヶ月、55,000億円、6/24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ものがあります。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