

●資金需給

単位：億円	2024年6月21日 需給速報		2024年6月24日 需給予想		2024年6月25日 当社予想					
銀行券	300		100		▲ 500					
財政	▲ 33,800		4,000		6,000					
資金過不足	▲ 33,500		4,100		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		▲ 300						
貸出支援基金（成）										
貸出支援基金（貸）										
被災地支援										
社債等買入	800	▲ 200								
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 25,100	29,100		25,100						
※ F T F 資金供給用国債国債提供給										
当預増減	▲ 29,000		28,900		5,500					
当座預金残高	5,541,900		5,570,800		5,576,300					
準備預金残高	4,915,100		6月24日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>7,800</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>400</td></tr></table>				積数	7,800	1日平均	400
積数	7,800									
1日平均	400									
積み終了先	4,913,400									
超過準備	4,913,100									
非準備預金先	626,800									
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 99.80%		日数		26.67%					

●短期金融市場関連指標

2024/6/21	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	0.045	0.078	0.077				－	0.084
T/N							－	0.086
S/N							－	－
1W							－	0.051
2W							－	0.050
3W							－	0.051
1M			0.165				－	0.051
3M			0.230				0.001	0.084
6M							0.010	0.138
1Y							0.120	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）
0.975	+0.025	38,596.47	▲ 36.55	158.93-95	158.76-79
日付	6/14	6/17	6/18	6/19	6/20
日銀当預残	5,478,600	5,483,000	5,488,900	5,509,700	5,570,900
準備預金残	4,828,200	4,844,200	4,854,800	4,870,800	4,926,800
マネタリーベース	6,715,100	6,718,800	6,724,100	6,745,200	6,806,800
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	115,510	120,391	121,296	120,588	121,266
うち無担	76,746	81,043	82,403	81,552	82,408
うちO/N	31,306	34,573	35,306	34,525	35,201
うち有担	38,764	39,348	38,893	39,036	38,858

●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	1239	－	55,000	2024/6/24	2024/9/24	131,376	41,796.5	99.9985	0.0059%	16.9607%	100.0009	▲0.0035%	13,203

●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）		2024/6/21	2024/6/24	▲0.150	25,679	25,679		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/6/21	2024/6/24	▲0.150	0	0				

●2024年6月24日の予定

*決定会合における主な意見（6月13・14日分）

◆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

●2024年6月21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、週末3日積みとなったが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、0.085～0.095%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＞

21日はTB3M物（第1239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、小甘く推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

＜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。