

Central Daily Market Report

2024年6月24日（月）
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24日 需給速報		2024年6月25日 需給予想		2024年6月26日 当社予想	
銀行券	100		100		▲ 500	
財政	▲ 2,400		8,900		▲ 15,000	
資金過不足	▲ 2,300		9,000		▲ 15,500	
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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			12,200			
CP等買入		▲ 300		▲ 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				▲ 300		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 25,000	25,100		25,000		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 2,500		45,600		▲ 23,500	
当座預金残高	5,539,400		5,585,000		5,561,500	
準備預金残高	4,932,400		6月25日以降の残り所要積立額 積数 5,900 1日平均 300			
積み終了先	4,930,600					
超過準備	4,930,600					
非準備預金先	607,000					
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 99.85%		日数		30.00%	

●2024年6月24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、0.085～0.095%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＞

24日のアウトラ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、一部の業態で大型発行が実施された。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

2024/6/24	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	0.050	0.125	0.081				－	0.084
T/N							－	0.086
S/N							－	－
1W							－	0.051
2W							－	0.053
3W							－	0.052
1M							－	0.052
3M							0.030	0.083
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)
0.985	+0.010	38,804.65	+208.18	159.89-91	159.68-70
日付	6/17	6/18	6/19	6/20	6/21
日銀当預残	5,483,000	5,488,900	5,509,700	5,570,900	5,541,900
準備預金残	4,844,200	4,854,800	4,870,800	4,926,800	4,915,100
マネタリーベース	6,718,800	6,724,100	6,745,200	6,806,800	6,777,500
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	120,391	121,296	120,588	121,266	116,980
うち無担	81,043	82,403	81,552	82,408	78,950
うちO/N	34,573	35,306	34,525	35,201	32,006
うち有担	39,348	38,893	39,036	38,858	38,030

●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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	3,750	2024/6/25			7,541	3,751	▲0.004		0.000	8.4
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,250	2024/6/25			7,968	4,253	▲0.001		0.002	20.6
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,250	2024/6/25			10,357	4,255	0.015		0.017	25.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/6/24	2024/6/25	▲0.150	25,608	25,608		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/6/24	2024/6/25	▲0.150	0	0				

●2024年6月25日の予定

*5月の企業向けサービス価格指数 *4月の景気動向指数改訂状況	*4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 *6月の米CB消費者信頼感指数	*20年利付国債入札 (10,000億円、6/26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