

Central Daily Market Report

2024年6月25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25日 需給速報	2024年6月26日 需給予想	2024年6月27日 当社予想
銀行券	0	▲ 100	▲ 1,000
財政	5,400	▲ 17,900	8,000
資金過不足	5,400	▲ 18,000	7,000

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	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	▲ 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		▲ 200				
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	▲ 26,900	25,000		26,900				
※ドル資金供給用担保提供供給								
当預増減	15,100		8,700					7,000

当座預金残高	5,554,500	5,563,200	5,570,200	
準備預金残高	4,951,600			
積み終了先	4,950,300		6月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,949,800		積数	4.100
非準備預金先	602,900		1日平均	200

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 99.90%	日数 33.33%

●短期金融市場関連指標

2024/6/25	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	0.065	0.150	0.078				-	0.077
T/N							-	0.084
S/N							-	-
1W			0.280				-	0.051
2W							-	0.052
3W							-	0.052
1M							-	0.052
3M							0.030	0.084
6M			0.400				0.000	0.139
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)
0.995	+0.010	39,173.15	+368.50	159.69-71	159.48-50

日付	6/18	6/19	6/20	6/21	6/24
日銀当預金	5,488,900	5,509,700	5,570,900	5,541,900	5,539,400
準備預金残	4,854,800	4,870,800	4,926,800	4,915,100	4,932,300
マネタリーベース	6,724,100	6,745,200	6,806,800	6,777,500	6,774,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.081%
コール市場残高	121,296	120,588	121,266	116,980	124,498
うち無担	82,403	81,552	82,408	78,950	86,750
うちO/N	35,306	34,525	35,201	32,006	40,101
うち有担	38,893	39,036	38,858	38,030	37,748

●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非価格競争入札(億円)
20年利付国債	188	1.6%	10,000	2024/6/26	2044/3/20	24,737	7,557	96.40	1.849%	71.6071%	96.47	1.843%	2,436

●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
米ドル資金供給		2024/6/27	2024/7/5	5.580	0	0				
CP等買入	3,000	2024/6/28			6,250	2,995	0.167		0.184	68.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/25	2024/6/26	▲0.150	27,512	27,512		▲0.150	▲0.164	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/6/26	2024/7/10	0.100	9,595	8,005				83.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/25	2024/6/26	▲0.150	0	0				

●2024年6月26日の予定

*5月の米新築一戸建て販売件数

◆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