

●資金需給

単位：億円	2024年6月26日 需給速報		2024年6月27日 需給予想		2024年6月28日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 400		▲ 200	
財政	▲ 21,200		▲ 6,400		7,800	
資金過不足	▲ 21,300		▲ 6,800		7,600	
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	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 400	3,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 24,000	26,900		24,000		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 18,600		16,800		10,600	
当座預金残高	5,535,900		5,552,700		5,563,300	
準備預金残高	4,937,000		6月27日以降の残り所要積立額 積数 2,700 1日平均 100			
積み終了先	4,935,700					
超過準備	4,935,700					
非準備預金先	598,900					
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 99.93%		日数		36.67%	

●2024年6月26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。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.03~0.08%程度での出合いとなった。
SC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＞

26日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で少額の出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は月末発行にあたり、大型発行を含め複数の業態で発行が観測された。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

2024/6/26	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	0.070	0.079	0.077				-	0.082
T/N							-	0.052
S/N							-	-
1W							-	0.050
2W	0.180	0.200	0.194				-	0.052
3W			0.200				-	0.052
1M							-	0.052
3M			0.250				0.025	0.084
6M			0.370				▲ 0.005	0.139
1Y							0.130	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)
1.020	+0.025	39,667.07	+493.92	159.70~71	159.89~91
日付					
日銀当預残	5,509,700	5,570,900	5,541,900	5,539,400	5,554,500
準備預金残	4,870,800	4,926,800	4,915,100	4,932,300	4,946,400
マネタリーベース	6,745,200	6,806,800	6,777,500	6,774,900	6,790,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.081%	0.078%
コール市場残高	120,588	121,266	116,980	124,498	119,208
うち無担	81,552	82,408	78,950	86,750	81,627
うちO/N	34,525	35,201	32,006	40,101	35,168
うち有担	39,036	38,858	38,030	37,748	37,581

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/26	2024/6/27	▲0.150	24,534	24,534		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/26	2024/6/27	▲0.150	0	0				

●2024年6月27日の予定

*月例経済報告 *1~3月期の資金循環統計速報 *5月の商業動態統計速報	*1~3月期の米GDP確報値 *5月の米耐久財新規受注	*2年利付国債入札 (26,000億円、7/1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論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		