

Central Daily Market Report

2024年6月27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27日 需給速報	2024年6月28日 需給予想	2024年7月1日 当社予想
銀行券	▲ 400	▲ 100	▲ 500
財政	▲ 6,500	▲ 3,400	▲ 8,000
資金過不足	▲ 6,900	▲ 3,500	▲ 8,500

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		▲ 400	3,000	▲ 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	▲ 26,600	24,000		26,600		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 9,900		23,100		▲ 8,500	

当座預金残高	5,526,000	5,549,100	5,540,600	
準備預金残高	4,918,300			
積み終了先	4,917,000	6月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,916,900	積数	1,300	
非準備預金先	607,700	1日平均	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	99.97%	日数	40.00%

●短期金融市場関連指標

2024/6/27	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				-	0.026
T/N							-	▲ 0.061
S/N							-	-
1W							-	0.027
2W			0.170				-	0.038
3W							-	0.044
1M	0.180	0.190	0.181				-	0.047
3M			0.210				0.025	0.084
6M							▲ 0.005	0.139
1Y							0.150	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)
1.070	+0.050	39,341.54	▲ 325.53	160.63-65	160.54-56
日付					
6/20	6/21	6/24	6/25	6/26	6/26
日銀当預残	5,570,900	5,541,900	5,539,400	5,554,500	5,535,900
準備預金残	4,926,800	4,915,100	4,932,300	4,946,400	4,937,000
マネタリーベース	6,806,800	6,777,500	6,774,900	6,790,000	6,771,500
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.081%	0.078%	0.077%
コール市場残高	121,266	116,980	124,498	119,208	117,424
うち無担	82,408	78,950	86,750	81,627	79,744
うちO/N	35,201	32,006	40,101	35,168	33,545
うち有担	38,858	38,030	37,748	37,581	37,680

●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 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
2年利付国債	462	0.4%	26,000	2024/7/1	2026/7/1	75,738	19,770	100.035	0.382%	60.0791%	100.043	0.378%	6.215	12.47

●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)		2024/6/27	2024/6/28	▲0.150	27,315	27,315		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/27	2024/6/28	▲0.150	0	0				

●2024年6月28日の予定

*6月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.0%)	*5月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1240回)入札 (3ヶ月、55,000億円、7/1発行)
*5月の完全失業率(市場予想:2.6%)	*6月のシカゴPM景況感指数	
*5月の有効求人倍率(市場予想:1.26倍)	*1-3月期の英GDP確報値	
*5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+2.0%)		
*5月の住宅着工統計		

◆本資料は信頼できると思わ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