

Central Daily Market Report

2024年6月28日（金）
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28日 需給速報		2024年7月1日 需給予想		2024年7月2日 当社予想					
銀行券	▲ 200		500		600					
財政	▲ 9,200		▲ 14,600		▲ 15,000					
資金過不足	▲ 9,400		▲ 14,100		▲ 14,400					
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			6,700							
CP等買入	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	▲ 25,400	26,600		25,400						
※ドル資金供給用国債国債供給										
当預増減	▲ 8,200		18,000		▲ 14,400					
当座預金残高	5,517,800		5,535,800		5,521,400					
準備預金残高	4,905,300		7月1日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>700</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				積数	700	1日平均	0
積数	700									
1日平均	0									
積み終了先	4,905,200									
超過準備	4,905,100									
非準備預金先	612,500									
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 99.98%		日数		50.00%					

●2024年6月28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、0.035～0.065%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＞

28日はTB3M物（第1240回）の入札が実施され、やや強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりで推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

＜CP市場＞

本日は入札発行が見受けられず、CP発行市場は閑散としたマーケットとなった。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

2024/6/28	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	0.060	0.079	0.076				－	0.028
T/N							－	0.047
S/N							－	－
1W							－	0.049
2W			0.150				－	0.049
3W							－	0.049
1M	0.190	0.270	0.212				－	0.051
3M							0.016	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）
1.040	▲ 0.030	39,583.08	+241.54	160.69-71	160.92-94
日付	6/21	6/24	6/25	6/26	6/27
日銀当預残	5,541,900	5,539,400	5,554,500	5,535,900	5,526,000
準備預金残	4,915,100	4,932,300	4,946,400	4,937,000	4,918,300
マネタリーベース	6,777,500	6,774,900	6,790,000	6,771,500	6,762,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.081%	0.078%	0.077%	0.077%
コール市場残高	116,980	124,498	119,208	117,424	116,685
うち無担	78,950	86,750	81,627	79,744	79,177
うちO/N	32,006	40,101	35,168	33,545	33,908
うち有担	38,030	37,748	37,581	37,680	37,508

●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	1240	－	55,000	2024/7/1	2024/9/30	146,845	41,795.5	99.9950	0.0200%	96.7946%	99.9960	0.0160%	13,204

●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3年超5年以下）	4,250	2024/7/1			7,656	4,252	0.001		0.003	100.0
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,500	2024/7/1			2,719	1,506	0.000		0.004	14.5
国債買入（残存期間25年超）	750	2024/7/1			1,394	752	0.004		0.007	47.1
国債買入（物価連動債）	600	2024/7/1			1,550	600		▲0.370	▲0.519	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/6/28	2024/7/1	▲0.350	25,907	25,907		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/6/28	2024/7/1	▲0.350	246	246		▲0.350	▲0.350	

●2024年7月1日の予定

*6月調査の日銀短観（概要及び要旨） （市場予想：大企業・製造業の業況判断指数（DI）+12） *6月の消費動向調査	*6月のISM製造業景況指数 *5月の米建設支出
--	-----------------------------

◆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