

Central Daily Market Report

2024年6月4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4日 需給速報	2024年6月5日 需給予想	2024年6月6日 当社予想		
銀行券	900	500	1,100		
財政	▲ 41,200	▲ 23,700	1,000		
資金過不足	▲ 40,300	▲ 23,200	2,100		
金融調節	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			▲ 100		
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	▲ 35,900	28,600	35,900		
当預増減	▲ 47,600	12,600	2,100		
当座預金残高	5,409,300	5,421,900	5,424,000		
準備預金残高	4,771,100				
積み終了先	4,770,200			6月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,770,200			積数	1,400
非準備預金先	638,200			1日平均	100
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					4,079,800
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数	64.52%	

●2024年6月4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、引き続き邦銀業態を中心に堅調な資金調達ニーズが見られており、出合いの水準は0.07~0.078%程度と横ばい圏で推移した。
ターム物は、目立った出合いがなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.06~0.075%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>

4日のアウトライ市場は動意なく閑散な中、6M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2024/6/4	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	0.070	0.078	0.077				-	0.072
T/N							-	0.066
S/N							-	-
1W	0.150	0.240	0.186				-	0.060
2W							-	0.059
3W							-	0.059
1M							-	0.059
3M							0.030	0.087
6M							0.058	0.133
1Y							0.205	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)
1.030	▲ 0.030	38,837.46	▲ 85.57	156.09-11	155.38-40
日付	5/28	5/29	5/30	5/31	6/3
日銀当預残	5,533,800	5,523,300	5,521,200	5,515,300	5,456,900
準備預金残	4,877,600	4,877,900	4,867,600	4,848,000	4,823,600
マネタリーベース	6,777,000	6,766,200	6,763,500	6,757,200	6,697,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.078%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	113,656	116,555	115,755	121,602	116,471
うち無担	74,804	76,749	76,284	83,324	78,190
うちO/N	31,234	33,079	32,344	38,974	33,560
うち有担	38,852	39,806	39,471	38,278	38,281

●入札結果

名称	回数	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非償格募入札(億円)	非償格入札(億円)
10年利付国債	374	0.8%	26,000	2024/6/5	2034/3/20	72,329	19,753	97.77	1.051%	70.1065%	97.79	1.048%	6,239	3,97

●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		2024/6/6	2024/6/13	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/4	2024/6/5	▲ 0.150	36,962	36,962		▲ 0.150	▲ 0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/4	2024/6/5	▲ 0.150	0	0				

●2024年6月5日の予定

*6月の日銀当座預金増減要因見込み
*4月の毎月勤労統計調査速報

*5月のISM非製造業景況指数

◆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ものがあります。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