

●資金需給

単位：億円	2024年6月10日 需給速報		2024年6月11日 需給予想		2024年6月12日 当社予想	
銀行券	500		400		0	
財政	▲ 5,100		▲ 3,400		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 4,600		▲ 3,000		▲ 3,000	
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
貸出						
全店共通						▲ 7,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,000					
CP等買入		▲ 500		▲ 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		▲ 100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 33,600	34,800		33,600		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	7,000		30,400		▲ 10,200	
当座預金残高	5,391,100		5,421,500		5,411,300	
準備預金残高	4,753,700		6月11日以降の残り所要積立額 積数 300 1日平均 100			
積み終了先	4,753,600					
超過準備	4,753,600					
非準備預金先	637,400					
積み期間（5/16～6/15）の所要準備額					4,081,200	
準備預金進捗率	実績 99.99%		日数		83.87%	

●2024年6月10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、3日積み要因が剥落したものの、引き続き邦銀業態を中心とした資金調達ニーズは強く、出合いの水準は0.072～0.078%程度で推移した。
ターム物は、ショートターム物での引き合いが見られた。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.045～0.065%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＞
10日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/6/10	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	0.050	0.145	0.078				－	0.080
T/N							－	0.043
S/N							－	－
1W	0.150	0.200	0.173				－	0.051
2W			0.150				－	0.052
3W							－	0.052
1M							－	0.051
3M							0.018	0.087
6M							0.043	0.134
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	+0.060	39,038.16	+354.23	156.82-84	156.99-01

日付	6/3	6/4	6/5	6/6	6/7
日銀当預残	5,456,900	5,409,300	5,384,000	5,387,100	5,384,100
準備預金残	4,823,600	4,771,500	4,741,900	4,739,800	4,732,300
マネタリーベース	6,697,900	6,649,400	6,623,500	6,626,200	6,622,500
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.078%
コール市場残高	116,471	119,124	119,012	125,436	123,142
うち無担	78,190	80,530	80,023	86,268	84,977
うちO/N	33,560	35,300	34,113	39,798	39,357
うち有担	38,281	38,594	38,989	39,168	38,165

●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）		2024/6/10	2024/6/11	▲0.150	34,390	34,390		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/6/10	2024/6/11	▲0.150	19	19		▲0.150	▲0.150	

●2024年6月11日の予定

*5月のマネーストック	*米FOMC（1日目）	*流動性供給入札 （6,000億円、6/12発行） *エネルギー対策借入 （8,199億円、6/20借入）
-------------	-------------	--

◆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