

Central Daily Market Report

2024年6月11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11日 需給速報	2024年6月12日 需給予想	2024年6月13日 当社予想
銀行券	300	600	▲1,000
財政	▲700	100	3,000
資金過不足	▲400	700	2,000

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			8,000	▲7,200		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲200		▲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	▲28,800	33,600		28,800		
当預増減	4,200		30,200		2,000	

当座預金残高	5,395,300	5,425,500	5,427,500	
準備預金残高	4,758,700			
積み終了先	4,758,700			
超過準備	4,758,700			
非準備預金先	636,600			
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	100.00%	日数	87.10%

●2024年6月11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とした資金調達ニーズは強く、出合いの水準は0.07~0.078%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、0.045~0.085%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>

11日のアウトライ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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。CP等買入オペが事前予定通り3,000億円でおfferされた。結果は按分レート0.158%、平均レート0.186%と前回(按分0.161%、平均0.177%)比で、按分レートは低下し、平均レートは上昇した。

●短期金融市場関連指標

2024/6/11	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	売買差	平均値
O/N	0.050	0.145	0.078				-	-	0.088
T/N							-	-	0.044
S/N							-	-	-
1W				0.350			-	-	0.051
2W							-	-	0.051
3W							-	-	0.051
1M							-	-	0.052
3M							0.018	-	0.087
6M							0.043	-	0.134
1Y							0.209	-	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	▲0.010	39,134.79	+96.63	157.03-05	157.34-35
日付	6/4	6/5	6/6	6/7	6/10
日銀当預残	5,409,300	5,384,000	5,387,100	5,384,100	5,391,100
準備預金残	4,771,500	4,741,900	4,739,800	4,732,300	4,753,700
マネタリーベース	6,649,400	6,623,500	6,626,200	6,622,500	6,629,100
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.078%	0.078%
コール市場残高	119,124	119,012	125,436	123,142	117,774
うち無担	80,530	80,023	86,268	84,977	79,352
うちO/N	35,300	34,113	39,798	39,357	33,242
うち有担	38,594	38,989	39,168	38,165	38,422

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第I非価格競争入札(億円)
流動性供給	407	-	6,000	2024/6/12	-	20,686	5,989		▲0.015%	65.6222%		▲0.017%	
エネルギー対策	-	-	8,199	2024/6/20	2025/6/20	32,445	8,199		0.330%	7.0000%		0.300%	

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
米ドル資金供給		2024/6/13	2024/6/21	5.580	0	0				
CP等買入	3,000	2024/6/14			4,500	3,000	0.158		0.186	25.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/11	2024/6/12	▲0.250	29,618	29,618		▲0.250	▲0.250	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/6/12	2024/6/26	0.100	9,740	8,006				82.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/11	2024/6/12	▲0.250		0				

●2024年6月12日の予定

*5月の企業物価指数

*米FOMC(2日目)

*FRB 米経済見通し発表

*5月の米消費者物価指数

*5月の米財政収支

◆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