

Central Daily Market Report

2024年6月12日(水)

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12日 需給速報		2024年6月13日 需給予想		2024年6月14日 当社予想	
銀行券	600		▲ 100		▲ 1,000	
財政	▲ 1,200		▲ 1,100		77,000	
資金過不足	▲ 600		▲ 1,200		76,000	
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			12,900			
CP等買入		▲ 100		▲ 200	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	▲ 33,300	28,800		33,300		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 4,400		44,800		79,000	
当座預金残高	5,390,900		5,435,700		5,514,700	
準備預金残高	4,743,100					
積み終了先	4,743,000		6月13日以降の残り所要積立額 積数 200 1日平均 100			
超過準備	4,743,000					
非準備預金先	647,800					
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		90.32%	

●短期金融市場関連指標

2024/6/12	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	0.040	0.212	0.078				-	0.077
T/N							-	0.047
S/N							-	-
1W			0.240				-	0.052
2W							-	0.052
3W							-	0.051
1M							-	0.052
3M							0.018	0.087
6M							0.043	0.135
1Y							0.200	0.201

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)
0.985	▲ 0.035	38,876.71	▲ 258.08	157.10~12	157.26~28
日付	6/5	6/6	6/7	6/10	6/11
日銀当預残	5,384,000	5,387,100	5,384,100	5,391,100	5,395,300
準備預金残	4,741,900	4,739,800	4,732,300	4,753,700	4,758,700
マネタリーベース	6,623,500	6,626,200	6,622,500	6,629,100	6,632,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.078%	0.078%	0.078%
コール市場残高	119,012	125,436	123,142	117,774	117,067
うち無担	80,023	86,268	84,977	79,352	79,219
うちO/N	34,113	39,798	39,357	33,242	33,159
うち有担	38,989	39,168	38,165	38,422	37,848

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/6/13			12,303	3,752	▲0.019		▲0.015	38.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/6/13			6,766	4,252	▲0.028		▲0.023	48.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/6/13			11,909	4,262	▲0.024		▲0.022	5.9
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/6/13			2,654	752	▲0.015		▲0.008	25.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/6/12	2024/6/13	▲0.250	34,216	34,216		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/12	2024/6/13	▲0.250	0	0				

●2024年6月13日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、14日まで)	*5月の米生産者物価指数	*国庫短期証券(1237回)入札(3ヶ月、55,000億円、6/17発行)
*4-6月期の法人企業景気予測調査季報		*流動性供給入札(5,000億円、6/14発行)

◆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