

●資金需給

単位：億円	2024年6月13日 需給速報		2024年6月14日 需給予想		2024年6月17日 当社予想	
銀行券	▲ 100		600		500	
財政	▲ 5,400		77,200		6,000	
資金過不足	▲ 5,500		77,800		6,500	
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	12,900					
CP等買入		▲ 200	3,000	▲ 300		
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	▲ 35,100	33,300		35,100		
※ FDL資金供給用国債国債供給						
当預増減	5,400		115,500		6,500	
当座預金残高	5,396,300		5,511,800		5,518,300	
準備預金残高	4,755,400		6月14日以降の残り所要積立額 積数 200 1日平均 100			
積み終了先	4,755,400					
超過準備	4,755,400					
非準備預金先	640,900					
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		93.55%	

●2024年6月13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、0.025～0.04%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＞
13日はTB3M物(第1237回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、強含みで推移した。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数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。

●短期金融市場関連指標

2024/6/13	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	0.040	0.078	0.077				－	0.011
T/N							－	0.030
S/N							－	－
1W							－	0.048
2W							－	0.049
3W							－	0.050
1M	0.190	0.220	0.205				－	0.048
3M			0.200				0.008	0.086
6M							0.035	0.134
1Y							0.195	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)
0.965	▲ 0.020	38,720.47	▲ 156.24	156.79-81	157.26-28

日付	6/6	6/7	6/10	6/11	6/12
日銀当預残	5,387,100	5,384,100	5,391,100	5,395,300	5,390,900
準備預金残	4,739,800	4,732,300	4,753,700	4,758,700	4,743,000
マネタリーベース	6,626,200	6,622,500	6,629,100	6,632,900	6,627,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.078%	0.078%	0.078%	0.078%
コール市場残高	125,436	123,142	117,774	117,067	115,142
うち無担	86,268	84,977	79,352	79,219	76,649
うちO/N	39,798	39,357	33,242	33,159	30,689
うち有担	39,168	38,165	38,422	37,848	38,493

●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	1237	－	55,000	2024/6/17	2024/9/17	157,930.8	41,491.6	99.9970	0.0119%	17.6292%	99.9980	0.0079%	13,508
流動性供給	408	－	5,000	2024/6/14	－	14,693	4,989	－	▲0.022%	68.0741%	－	▲0.024%	－

●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)		2024/6/13	2024/6/14	▲0.250	35,325	35,325		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/13	2024/6/14	▲0.250	607	607		▲0.250	▲0.250	

●2024年6月14日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*6月のミシガン大消費者信頼感指数速報
*日銀総裁定例会見	
*4月の第3次産業活動指数	

◆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