

Central Daily Market Report

2024年6月14日(金)

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14日 需給速報		2024年6月17日 需給予想		2024年6月18日 当社予想					
銀行券	500		800		500					
財政	78,600		▲ 700		1,000					
資金過不足	79,100		100		1,500					
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										
CP等買入	3,000	▲ 300		▲ 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		▲ 100								
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 34,500	35,100		34,500						
※ F D 資金供給用国債補完供給										
当預増減	82,300		34,500		1,500					
当座預金残高	5,478,600		5,513,100		5,514,600					
準備預金残高	4,828,200		6月17日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>492,100</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>17,000</td></tr></table>				積数	492,100	1日平均	17,000
積数	492,100									
1日平均	17,000									
積み終了先	4,828,200									
超過準備	4,828,100									
非準備預金先	650,400									
積み期間（6/16～7/15）の所要準備額					3,942,000					
準備預金進捗率	実績	87.52%	日数	3.33%						

●短期金融市場関連指標

2024/6/14	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	0.150	0.077				-	0.037
T/N							-	0.032
S/N							-	-
1W							-	0.043
2W			0.130				-	0.043
3W							-	0.044
1M			0.230				-	0.041
3M			0.200				0.000	0.086
6M							0.025	0.135
1Y							0.165	0.200

●入札結果

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)		2024/6/14	2024/6/17	▲0.250	35,440	35,440		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/6/14	2024/6/17	▲0.250	1	1		▲0.250	▲0.250	

●2024年6月17日の予定

*4月の機械受注統計

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した(全員一致)。

無担保コールレート(オーバーナイト物)を、0~0.1%程度で推移するよう促す。

次回金融政策決定会合までの長期国債およびCP等・社債等の買入れについては、2024年3月の金融政策決定会合において決定された方針に沿って実施する。その後については、金融市場において長期金利がより自由な形で形成されるよう、長期国債買入れを減額していく方針を決定した(賛成8反対1)。市場参加者の意見も確認し、次回金融政策決定会合において、今後1~2年程度の具体的な減額計画を決定する。

◆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

●2024年6月14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、積み最終日を迎えたが、市場に大きな変化は見られず、引き続き邦銀業態を中心とした強い資金調達ニーズから、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。

また、13日(木)から14日(金)にかけて開催された金融政策決定会合では、金融市場調節方針の現状維持が決定された。合わせて「長期国債買入れを減額していく方針を決定」し、「市場参加者の意見も確認し、次回金融政策決定会合において、今後1~2年程度の具体的な減額計画を決定する」ことが発表された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.025~0.095%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＞

14日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

＜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。

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)
0.930	▲ 0.035	38,814.56	+94.09	157.11~13	157.66~68
日付	6/7	6/10	6/11	6/12	6/13
日銀当預残	5,384,100	5,391,100	5,395,300	5,390,900	5,396,300
準備預金残	4,732,300	4,753,700	4,758,700	4,743,000	4,755,400
マネタリーベース	6,622,500	6,629,100	6,632,900	6,627,900	6,633,400
無担O/N加重平均	0.078%	0.078%	0.078%	0.078%	0.077%
コール市場残高	123,142	117,774	117,067	115,142	116,797
うち無担	84,977	79,352	79,219	76,649	77,443
うちO/N	39,357	33,242	33,159	30,689	31,413
うち有担	38,165	38,422	37,848	38,493	39,354