

# Central Daily Market Report

2024年5月1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5月1日 需給速報	2024年5月2日 需給予想	2024年5月7日 当社予想			
銀行券	▲ 700	▲ 400	4,000			
財政	▲ 82,800	▲ 22,700	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 83,500	▲ 23,100	▲ 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	6,500	▲ 7,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 700	▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 34,800	38,900	34,800			
当預増減	▲ 80,600	11,400	▲ 3,000			
当座預金残高	5,622,800	5,634,200	5,631,200			
準備預金残高	4,951,500					
積み終了先	4,951,400			5月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,951,400			積数	600	
非準備預金先	671,300			1日平均	0	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						3,955,000
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	53.33%		

## ●2024年5月1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に資金調達ニーズの強い展開となった。出合い水準は0.070~0.078%程度と概ね横ばい圏で推移したが、月末要因の剥落により調達を再開する先が見られた。資金需給は、為替介入による影響があったと思われる、財政等要因が大幅なマイナス予想となっていたが、コール市場への影響は見られなかった。ターム物は、一部業態による調達が散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.04~0.095%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>

1日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2024/5/1	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	0.050	0.078	0.077				-	0.073
T/N							-	0.045
S/N							-	-
1W			0.240				-	0.034
2W			0.160				-	0.034
3W							-	0.034
1M	0.150	0.170	0.160				-	0.037
3M	0.170	0.220	0.195				0.020	0.051
6M							0.040	0.076
1Y							0.130	0.114

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)
0.890	+0.020	38,274.05	▲131.61	157.74-76	157.88-90
日付	4/23	4/24	4/25	4/26	4/30
日銀当預残	5,705,500	5,701,300	5,700,000	5,699,600	5,703,400
準備預金残	5,016,400	5,007,500	5,004,100	5,010,700	5,021,700
マネタリーベース	6,960,000	6,957,300	6,957,100	6,957,900	6,962,600
無担O/N加重平均	0.076%	0.077%	0.077%	0.077%	0.076%
コール市場残高	109,847	114,895	115,617	115,077	116,554
うち無担	73,130	78,557	78,302	79,366	85,556
うちO/N	30,307	34,364	33,759	35,843	42,473
うち有担	36,717	36,338	37,315	35,711	30,998

## ●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*	応募総額(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)		2024/5/1	2024/5/2	▲0.250	35,461	35,461		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/1	2024/5/2	▲0.250	0	0				

## ●5月2日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(3月18・19日分)	*3月の米貿易収支	*国庫短期証券(1228回)入札(3ヶ月、58,000億円、5/7発行)
*4月のマネタリーベース	*3月の米製造業新規受注・出荷・在庫	*流動性供給入札(5,000億円、5/7発行)
*4月の消費動向調査		
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み		

◆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