

Central Daily Market Report

2024年5月7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5月7日 需給速報	2024年5月8日 需給予想	2024年5月9日 当社予想			
銀行券	1,200	2,700	3,000			
財政	▲ 40,500	4,900	▲ 26,000			
資金過不足	▲ 39,300	7,600	▲ 23,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,800			
CP等買入		▲ 100	▲ 400			
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	▲ 36,000	32,600	36,000			
当預増減	▲ 42,800	54,000	▲ 23,000			
当座預金残高	5,549,900	5,603,900	5,580,900			
準備預金残高	4,898,100					
積み終了先	4,898,100			5月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,898,100			積数	200	
非準備預金先	651,800			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	99.99%	日数	73.33%		

●2024年5月7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、5日積み要因は剥落したものの、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、出合いの水準は0.070~0.078%程度で推移した。
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、0.065~0.075%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>

7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。

●短期金融市場関連指標

2024/5/7	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	売買参考計値	平均値
O/N	0.060	0.078	0.077				-	0.072
T/N							-	0.069
S/N							-	-
1W							-	0.052
2W	0.150	0.300	0.200				-	0.048
3W	0.160	0.180	0.170				-	0.048
1M			0.150				-	0.049
3M			0.580				0.033	0.053
6M							0.050	0.075
1Y							0.130	0.115

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)
0.870	▲ 0.030	38,835.10	+599.03	154.24-25	154.11-12
日付	4/25	4/26	4/30	5/1	5/2
日銀当預残	5,700,000	5,699,600	5,703,400	5,622,800	5,592,700
準備預金残	5,004,100	5,010,700	5,021,700	4,951,000	4,916,300
マネタリーベース	6,957,100	6,957,900	6,962,600	6,882,700	6,853,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%	0.077%
コール市場残高	115,617	115,077	116,554	117,000	119,849
うち無担	78,302	79,366	85,556	80,673	83,170
うちO/N	33,759	35,843	42,473	36,340	39,407
うち有担	37,315	35,711	30,998	36,327	36,679

●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2024/5/8			4,312	1,502	0.001		0.009	5.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/5/8			6,548	3,752	▲0.005		▲0.003	38.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/5/8			10,678	4,256	▲0.009		▲0.008	42.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/5/8			3,196	1,507	▲0.007		▲0.005	95.6
米ドル資金供給		2024/5/9	2024/5/16	5.580	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/5/7	2024/5/8	▲0.150	36,815	36,815		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/7	2024/5/8	▲0.150	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2024/5/8	2024/5/17		2	2		0.000	0.000	

●2024年5月8日の予定

*3月の米卸売上高	*10年利付国債入札(26,000億円、5/9発行) *交付税特別会計借入(13,000億円、5/16借入)
-----------	---

◆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