

Central Daily Market Report

2024年5月8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8日 需給速報	2024年5月9日 需給予想	2024年5月10日 当社予想			
銀行券	2,700	2,000	2,000			
財政	7,800	▲ 33,700	▲ 1,000			
資金過不足	10,500	▲ 31,700	1,000			
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		▲ 400		▲ 500		
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	▲ 39,700	36,000		39,700		
※ドル資金供給用信託国債供給						
当預増減	17,200		7,500		1,000	
当座預金残高	5,567,100		5,574,600		5,575,600	
準備預金残高	4,905,200		5月9日以降の残り所要積立額 積数 200 1日平均 0			
積み終了先	4,905,200					
超過準備	4,905,200					
非準備預金先	661,900					
積み期間（4/16～5/15）の所要準備額					3,961,600	
準備預金進捗率	実績 99.99%		日数		76.67%	

●2024年5月8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、1M～3M物で引き合いが散見された。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.07～0.085%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＞

8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発行市場は数件の発行が観測され、一部で大型発行も見られた。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

2024/5/8	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	0.060	0.078	0.077				－	0.072
T/N							－	0.073
S/N							－	－
1W							－	0.058
2W							－	0.051
3W							－	0.049
1M							－	0.050
3M							0.033	0.055
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）
0.875	+0.005	38,202.37	▲ 632.73	154.77-79	155.32-34
日付	4/26	4/30	5/1	5/2	5/7
日銀当預残	5,699,600	5,703,400	5,622,800	5,592,700	5,549,900
準備預金残	5,010,700	5,021,700	4,951,000	4,916,300	4,897,200
マネタリーベース	6,957,900	6,962,600	6,882,700	6,853,000	6,809,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.076%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	115,077	116,554	117,000	119,849	115,792
うち無担	79,366	85,556	80,673	83,170	77,640
うちO/N	35,843	42,473	36,340	39,407	35,117
うち有担	35,711	30,998	36,327	36,679	38,152

●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1非価格 競争入札（億円）	非競争 入札（億円）
10年利付国債	374	0.8%	26,000	2024/5/9	2034/3/20	61,918	19,649	99.43	0.862%	79.2058%	99.48	0.857%	6,340	3.17
交付税特会	－	－	13,000	2024/5/16	2024/11/15	71,991	12,990		0.115%	63.1295%		0.113%		10

●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）		2024/5/8	2024/5/9	▲0.150	40,491	40,491		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/5/8	2024/5/9	▲0.150	0	0				

●2024年5月9日の予定

*決定会合における主な意見（4月25・26日分） *4月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *3月の毎月勤労統計調査速報 *3月の景気動向指数速報	*英中銀MPC	*国庫短期証券（1229回）入札 （6ヶ月、40,000億円、5/10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