

Central Daily Market Report

2024年5月9日(木)
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9日 需給速報		2024年5月10日 需給予想		2024年5月13日 当社予想	
銀行券	2,100		2,200		1,000	
財政	▲ 32,900		▲ 4,700		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 30,800		▲ 2,500		▲ 11,000	
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						
CP等買入		▲ 500		▲ 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	▲ 38,600	39,700		38,600		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 30,200		35,700		▲ 11,000	
当座預金残高	5,536,900		5,572,600		5,561,600	
準備預金残高	4,885,600					
積み終了先	4,885,500		5月10日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,885,500		積数 100			
非準備預金先	651,300		1日平均 0			
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 100.00%		日数		80.00%	

●2024年5月9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、引続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、出会いの水準は0.070~0.078%程度で推移した。
ターム物は、目立った出会いがなく閑散であった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.07~0.115%程度での出会いとなった。
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＞

9日はTB6M物(第1229回)の入札が実施され、ややテールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかり推移した。

＜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

2024/5/9	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	0.060	0.078	0.077				-	0.071
T/N							-	0.076
S/N							-	-
1W			0.240				-	0.059
2W	0.160	0.195	0.185				-	0.051
3W							-	0.049
1M	0.110	0.230	0.185				-	0.050
3M							0.040	0.056
6M			0.350				0.080	0.076
1Y							0.130	0.117

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)
0.905	+0.030	38,073.98	▲ 128.39	155.37-39	155.82-84
日付	4/30	5/1	5/2	5/7	5/8
日銀当預残	5,703,400	5,622,800	5,592,700	5,549,900	5,567,100
準備預金残	5,021,700	4,951,000	4,916,300	4,897,200	4,905,200
マネタリーベース	6,962,600	6,882,700	6,853,000	6,809,000	6,823,500
無担O/N加重平均	0.076%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	116,554	117,000	119,849	115,792	126,883
うち無担	85,556	80,673	83,170	77,640	88,159
うちO/N	42,473	36,340	39,407	35,117	46,101
うち有担	30,998	36,327	36,679	38,152	38,724

●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	1229	-	40,000	2024/5/10	2024/11/11	101,292.3	31,233.7	99.952	0.0947%	67.6182%	99.960	0.0789%	8,766

●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)		2024/5/9	2024/5/10	▲0.150	39,417	39,417		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/9	2024/5/10	▲0.150	0	0				

●2024年5月10日の予定

*3月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比▲ 2.4%) *3月の国際収支 *4月の景気ウォッチャー調査	*5月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *4月の米財政収支 *1-3月期の英GDP速報値	*国庫短期証券(1230回)入札 (3ヶ月、58,000億円、5/13発行) *30年利付国債入札 (9,000億円、5/13発行) *エネルギー対策借入 (8,682億円、5/20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