

Central Daily Market Report

2024年5月10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5月10日 需給速報	2024年5月13日 需給予想	2024年5月14日 当社予想			
銀行券	2,300	1,600	2,000			
財政	▲ 8,700	▲ 15,200	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 6,400	▲ 13,600	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						
CP等買入		▲ 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	▲ 34,400	38,600		34,400		
当預増減	▲ 2,600		20,800			1,000
当座預金残高	5,534,300		5,555,100			5,556,100
準備預金残高	4,876,900					
積み終了先	4,876,900				5月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,876,900				積数	0
非準備預金先	657,400				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		90.00%

●2024年5月10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、週末3日積み要因も相まって、引き続き邦銀業態からの資金調達ニーズが強かったことから、出合いの水準は0.07~0.078%程度で推移した。
ターム物は、目立った出合いがなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.075~0.105%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>

10日はTB3M物(第1230回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は大型発行を含め、複数の業態で発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/5/10	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				-	0.090
T/N								-	0.094
S/N								-	-
1W								-	0.074
2W				0.150				-	0.067
3W								-	0.061
1M				0.220				-	0.057
3M				0.185				0.030	0.061
6M								0.081	0.081
1Y								0.130	0.121

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	0.000	38,229.11	+155.13	155.39-41	155.68-70
日付	5/1	5/2	5/7	5/8	5/9
日銀当預残	5,622,800	5,592,700	5,549,900	5,567,100	5,536,900
準備預金残	4,951,000	4,916,300	4,897,200	4,905,200	4,882,800
マネタリーベース	6,882,700	6,853,000	6,809,000	6,823,500	6,791,200
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	117,000	119,849	115,792	126,883	125,206
うち無担	80,673	83,170	77,640	88,159	87,065
うちO/N	36,340	39,407	35,117	46,101	45,167
うち有担	36,327	36,679	38,152	38,724	38,141

●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)
国庫短期証券	1230	-	58,000	2024/5/13	2024/8/13	149,061	44,081.3	99.9865	0.0535%	19.0427%	99.9880	0.0476%	13,918
30年利付国債	82	1.8%	9,000	2024/5/13	2054/3/20	22,098	6,809	96.10	2.008%	9.1240%	96.40	1.992%	2,188
エネルギー対策	-	-	8,682	2024/5/20	2025/5/20	34,069	8,681.99		0.250%	98.7479%		0.232%	

●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)		2024/5/10	2024/5/13	▲0.150	34,935	34,935		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/10	2024/5/13	▲0.150	162	162		▲0.150	▲0.150	

●2024年5月13日の予定

*4月のマネーストック

◆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