

# Central Daily Market Report

2024年5月15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15日 需給速報	2024年5月16日 需給予想	2024年5月17日 当社予想
銀行券	1,200	900	1,000
財政	▲ 27,600	▲ 6,600	▲ 10,000
資金過不足	▲ 26,400	▲ 5,700	▲ 9,000

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	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	7,000	▲ 6,500						
国債買現								
国債売現								
国庫短期証買入								
国債買入								
CP等買入		▲ 500		▲ 200		3,000		
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	▲ 30,400	33,900		30,400				
当増減	▲ 22,900		24,500		▲ 6,000			

当座預金残高	5,505,100	5,529,600	5,523,600	
準備預金残高	4,864,000			
積み終了先	4,864,000			
超過準備	4,864,000			
非準備預金先	641,100			
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額			4,079,800	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%

## ●2024年5月15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、積み期最終日となったものの影響はほとんど見られず、邦銀業態から資金調達ニーズがみられたことで、出会い水準は引き続き変わりなく0.07~0.078%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、0.06~0.08%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>

15日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額出会いが見られた。

### <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

2024/5/15	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	0.060	0.078	0.077				-	0.080
T/N							-	0.076
S/N							-	-
1W							-	0.070
2W							-	0.062
3W							-	0.061
1M							-	0.059
3M							0.030	0.066
6M							0.095	0.092
1Y							0.195	0.141

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)
0.950	▲ 0.008		38,385.73	+29.67		156.51-54	156.09-11
日付	5/8	5/9	5/10	5/13	5/14		
日銀当預残	5,567,100	5,536,900	5,534,300	5,519,600	5,528,000		
準備預金残	4,905,200	4,882,800	4,877,000	4,872,300	4,880,200		
マネタリーベース	6,823,500	6,791,200	6,786,400	6,770,000	6,776,900		
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	126,883	125,206	116,058	120,043	119,822		
うち無担	88,159	87,065	78,412	83,133	82,391		
うちO/N	46,101	45,167	37,439	42,115	41,523		
うち有担	38,724	38,141	37,646	36,910	37,431		

## ●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I非価格競争入札(億円)
今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)		2024/5/15	2024/5/16	▲0.150	31,126	31,126		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/15	2024/5/16	▲0.150	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
被災地金融支援オペ	第24回	2024/5/17	2025/5/12	0.1	0

## ●2024年5月16日の予定

*1-3月期のGDP 1次速報	*4月の米住宅着工件数 *4月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1231回)入札 (1年、32,000億円、5/20発行) *20年利付国債入札 (10,000億円、5/17発行) *国有林野借入 (499億円、5/27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