

# Central Daily Market Report

2024年5月16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16日 需給速報	2024年5月17日 需給予想	2024年5月20日 当社予想		
銀行券	1,000	700	1,500		
財政	▲ 1,100	▲ 8,200	2,000		
資金過不足	▲ 100	▲ 7,500	3,500		
金融調節	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		▲ 200	3,000	▲ 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	▲ 33,100	30,400	33,100		
当預増減	▲ 3,000	28,100	3,500		
当座預金残高	5,502,100	5,530,200	5,533,700		
準備預金残高	4,845,600				
積み終了先	3,561,800			5月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,361,300			積数	595,500
非準備預金先	656,500			1日平均	19,900
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	85.40%	日数	3.23%	

## ●2024年5月16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、新積み期に入ったが邦銀業態を中心に資金調達ニーズの強い状況に変わりはなく、出合い水準は引き続き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、0.045~0.07%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>

本日はTB1Y物(第1231回)の入札が実施され、事前予想通り無難な結果となった。その後のセカンダリーマーケットでも、堅調に推移した。このほか、6M物にも出合いが見られた。

### <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

2024/5/16	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	0.070	0.078	0.077				-	0.044
T/N							-	0.043
S/N							-	-
1W							-	0.058
2W							-	0.059
3W							-	0.057
1M				0.200			-	0.052
3M				0.190			0.030	0.065
6M							0.085	0.095
1Y							0.185	0.151

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)
0.920	▲ 0.030	38,920.26	+534.53	154.29-31	154.41-42
日付	5/9	5/10	5/13	5/14	5/15
日銀当預残	5,536,900	5,534,300	5,519,600	5,528,000	5,505,100
準備預金残	4,882,800	4,877,000	4,872,300	4,880,200	4,864,000
マネタリーベース	6,791,200	6,786,400	6,770,000	6,776,900	6,752,800
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	125,206	116,058	120,043	119,822	121,702
うち無担	87,065	78,412	83,133	82,391	83,666
うちO/N	45,167	37,439	42,115	41,523	43,128
うち有担	38,141	37,646	36,910	37,431	38,036

## ●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	1231	-	32,000	2024/5/20	2025/5/20	105,550	24,178.3	99.790	0.2104%	11.2449%	99.797	0.2034%	7,821
20年利付国債	188	1.6%	10,000	2024/5/17	2044/3/20	27,551	7,555	97.90	1.742%	24.4913%	98.01	1.734%	2,436
国有林野借入	-	-	499	2024/5/27	2029/5/25	2,846	499		0.398%	100.0000%		0.398%	

## ●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)		2024/5/16	2024/5/17	▲0.150	33,950	33,950		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/16	2024/5/17	▲0.150	0	0				

## ●2024年5月17日の予定

*3月の石油等消費動態統計	*4月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(1232回)入札(3ヶ月、58,000億円、5/20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