

Central Daily Market Report

2024年5月17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17日 需給速報	2024年5月20日 需給予想	2024年5月21日 当社予想		
銀行券	800	400	1,000		
財政	▲ 10,000	1,500	▲ 2,500		
資金過不足	▲ 9,200	1,900	▲ 1,500		
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		13,000			
CP等買入	3,000	▲ 500	▲ 100		
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	▲ 30,500	33,100	30,500		
当増減	▲ 4,100	45,300	▲ 1,500		
当座預金残高	5,498,000	5,543,300	5,541,800		
準備預金残高	4,847,300				
積み終了先	4,839,600			5月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,657,400			積数	24,800
非準備預金先	650,700			1日平均	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	99.39%	日数	12.90%	

●2024年5月17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、引き続き邦銀業態から資金調達ニーズが堅調にみられたことで、出合い水準は引続き変わりなく0.07~0.078%程度で推移した。
ターム物は、目立った出合いがなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.08~0.09%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TB3M物(第1232回)の入札が実施され、やや強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。その他、1Y物で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

2024/5/17	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	0.070	0.078	0.077				-	0.075
T/N							-	0.081
S/N							-	-
1W	0.119	0.240	0.130				-	0.063
2W							-	0.060
3W							-	0.059
1M	0.160	0.215	0.167				-	0.057
3M							0.035	0.072
6M							0.085	0.094
1Y							0.190	0.156

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)
0.945	+0.025	38,787.38	▲ 132.88	155.39-41	155.81-83
日付	5/10	5/13	5/14	5/15	5/16
日銀当預残	5,534,300	5,519,600	5,528,000	5,505,100	5,502,100
準備預金残	4,877,000	4,872,300	4,880,200	4,864,000	4,845,600
マネタリーベース	6,786,400	6,770,000	6,776,900	6,752,800	6,748,900
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	116,058	120,043	119,822	121,702	110,510
うち無担	78,412	83,133	82,391	83,666	72,570
うちO/N	37,439	42,115	41,523	43,128	31,832
うち有担	37,646	36,910	37,431	38,036	37,940

●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	1232	-	58,000	2024/5/20	2024/8/19	159,622.9	44,081.2	99,9880	0.0481%	22.3800%	99.9897	0.0413%	13,918

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/5/20			7,440	3,751	0.003		0.006	1.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/5/20			7,691	4,254	0.006		0.008	84.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/5/20			11,634	4,257	0.008		0.009	70.2
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/5/20			2,359	753	0.028		0.031	64.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/5/17	2024/5/20	▲0.250	31,210	31,210		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/17	2024/5/20	▲0.250	0	0				

●2024年5月20日の予定

*3月の第3次産業活動指数	*10年物価連動国債(2,500億円、5/21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場合があります。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