

# Central Daily Market Report

2024年5月21日(火)

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21日 需給速報	2024年5月22日 需給予想	2024年5月23日 当社予想			
銀行券	600	400	▲ 500			
財政	▲ 2,700	0	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 2,100	400	▲ 7,500			
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		▲ 100		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 30,800	30,900		30,800		
当増減	▲ 2,100		30,300		▲ 7,500	
当座預金残高	5,515,100		5,545,400		5,537,900	
準備預金残高	4,863,600					
積み終了先	4,861,800					
超過準備	4,861,600					
非準備預金先	651,500					
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	99.56%	日数	19.35%		

## ●2024年5月21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、0.045~0.05%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>

21日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、6M物と1Y物で出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2024/5/21	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	0.055	0.078	0.077				-	0.042
T/N							-	0.045
S/N							-	-
1W							-	0.058
2W	0.150	0.160	0.153				-	0.057
3W							-	0.057
1M	0.110	0.150	0.147				-	0.057
3M			0.180				0.035	0.075
6M							0.090	0.098
1Y							0.195	0.167

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)
0.980	+0.005	38,946.93	▲ 122.75	156.38-40	156.22-24
日付	5/14	5/15	5/16	5/17	5/20
日銀当預残	5,528,000	5,505,100	5,502,100	5,498,000	5,517,200
準備預金残	4,880,200	4,864,000	4,845,600	4,847,300	4,871,400
マネタリーベース	6,776,900	6,752,800	6,748,900	6,743,900	6,762,700
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	119,822	121,702	110,510	112,192	115,333
うち無担	82,391	83,666	72,570	74,293	77,471
うちO/N	41,523	43,128	31,832	33,465	36,023
うち有担	37,431	38,036	37,940	37,899	37,862

## ●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非償還額募入(億円)	非償還募入(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2024/5/29	2024/11/27	45,934	12,990.01		0.120%	58.8004%		0.119%		10

## ●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
米ドル資金供給		2024/5/23	2024/5/30	5.580	0	0				
社債等買入	750	2024/5/24			1,646	750	0.587		0.607	14.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/5/21	2024/5/22	▲0.150	31,587	31,587		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/21	2024/5/22	▲0.150	0	0				

## ●2024年5月22日の予定

*3月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲2.2%)	*4月の米中古住宅販売 *4月の英消費者物価指数	*40年利付国債入札 (7,000億円、5/23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よう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