

Central Daily Market Report

2024年5月23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23日 需給速報	2024年5月24日 需給予想	2024年5月27日 当社予想
銀行券	200	200	1,000
財政	2,200	2,200	▲ 5,000
資金過不足	2,400	2,400	▲ 4,000

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			12,100			
CP等買入				▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			800	▲ 600		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 26,200	27,900		26,200		
当増減	4,100		40,700		▲ 4,000	

当座預金残高	5,521,900	5,562,600	5,558,600	
準備預金残高	4,872,500			
積み終了先	4,870,900			
超過準備	4,870,800			
非準備預金先	649,400			
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	99.65%	日数	25.81%

●2024年5月23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、0.04~0.075%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>

23日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、6M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で発行が実施され、一部の業態では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

2024/5/23	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	0.060	0.078	0.077				-	0.082
T/N							-	0.073
S/N							-	-
1W				0.119			-	0.064
2W	0.210	0.300	0.223				-	0.061
3W							-	0.061
1M	0.250	0.270	0.258				-	0.060
3M			0.175				0.038	0.076
6M							0.080	0.099
1Y							0.195	0.178

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)
1.000	+0.005		39,103.22	+486.12		156.73-75	156.76-77
日付	5/16	5/17	5/20	5/21	5/22		
日銀当預残	5,502,100	5,498,000	5,517,200	5,515,100	5,517,800		
準備預金残	4,845,600	4,847,300	4,871,400	4,863,600	4,859,500		
マネタリーベース	6,748,900	6,743,900	6,762,700	6,760,000	6,762,300		
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	110,510	112,192	115,333	117,300	115,883		
うち無担	72,570	74,293	77,471	79,628	77,714		
うちO/N	31,832	33,465	36,023	38,080	35,526		
うち有担	37,940	37,899	37,862	37,672	38,169		

●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非償還額募入札(億円)	非償還額募入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2024/5/31	2024/11/29	47,647	12,990.02		0.125%	67.5600%		0.120%		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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/5/24			3,564	3,564		▲0.010	▲0.003	
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/5/24			9,844	4,255	▲0.005		▲0.004	78.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/5/24			10,031	4,255	▲0.004		▲0.002	78.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/5/23	2024/5/24	▲0.150	26,945	26,945		▲0.150	▲0.151	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/23	2024/5/24	▲0.150	33	33		▲0.150	▲0.150	

●2024年5月24日の予定

*4月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.2%)	*4月の米耐久財新規受注	*国庫短期証券(1233回)入札 (3ヶ月、58,000億円、5/27発行) *流動性供給入札 (6,000億円、5/27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