

Central Daily Market Report

2024年5月24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24日 需給速報		2024年5月27日 需給予想		2024年5月28日 当社予想	
銀行券	200		400		▲ 500	
財政	3,900		▲ 6,500		10,000	
資金過不足	4,100		▲ 6,100		9,500	
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	12,100					
CP等買入		▲ 200		▲ 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	700	▲ 600		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 27,200	26,200		27,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	15,100		20,800		9,500	
当座預金残高	5,537,000		5,557,800		5,567,300	
準備預金残高	4,879,500					
積み終了先	4,878,000		5月27日以降の残り所要積立額 積数 9,200 1日平均 500			
超過準備	4,877,900					
非準備預金先	657,500					
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 99.77%		日数		35.48%	

●2024年5月24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、0.07～0.085%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＞
24日はTB3M物（第1233回）の入札が実施され、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。

＜CP市場＞
CP発行市場は、数件の入札が実施され、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

2024/5/24	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	0.065	0.078	0.078				－	0.030
T/N							－	0.079
S/N							－	－
1W							－	0.065
2W	0.160	0.190	0.176				－	0.062
3W							－	0.061
1M							－	0.060
3M	0.200	0.230	0.223				0.015	0.077
6M							0.080	0.099
1Y							0.195	0.183

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）
1.005	+0.005	38,646.11	▲ 457.11	156.98-01	157.04-06

日付	5/17	5/20	5/21	5/22	5/23
日銀当預残	5,498,000	5,517,200	5,515,100	5,517,800	5,521,900
準備預金残	4,847,300	4,871,400	4,863,600	4,859,500	4,872,900
マネタリーベース	6,743,900	6,762,700	6,760,000	6,762,300	6,766,300
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	112,192	115,333	117,300	115,883	117,743
うち無担	74,293	77,471	79,628	77,714	78,138
うちO/N	33,465	36,023	38,080	35,526	35,345
うち有担	37,899	37,862	37,672	38,169	39,605

●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Ⅰ非価格競争入札（億円）
国庫短期証券	1233	－	58,000	2024/5/27	2024/8/26	166,935.8	43,760.4	99.9895	0.0421%	79.1898%	99.9900	0.0401%	14,239
流動性供給	406	－	6,000	2024/5/27	－	18,108	5,993		▲0.002%	54.2834%		▲0.006%	

●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）		2024/5/24	2024/5/27	▲0.150	27,877	27,877		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/5/24	2024/5/27	▲0.150	0	0				

●2024年5月27日の予定

*日本銀行金融研究所主催2024年国際コンファランスにおいて 植田日銀総裁講演 *日本銀行金融研究所主催2024年国際コンファランスにおいて 内田日銀副総裁基調講演 *月例経済報告（内閣府） *3月の景気動向指数改訂状況	*New York祝日（Memorial Day） *London祝日（Spring bank holiday）
◆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	