

# Central Daily Market Report

2024年5月28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28日 需給速報	2024年5月29日 需給予想	2024年5月30日 当社予想			
銀行券	500	200	▲ 300			
財政	10,000	▲ 7,500	▲ 3,000			
資金過不足	10,500	▲ 7,300	▲ 3,300			
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			7,200	▲ 7,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 600	▲ 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						
国債補充供給	▲ 28,700	28,000	28,700			
当預増減	9,200	21,100	▲ 3,300			
当座預金残高	5,533,800	5,554,900	5,551,600			
準備預金残高	4,877,300					
積み終了先	4,876,300			5月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,876,300			積数	6,900	
非準備預金先	656,500			1日平均	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	99.83%	日数	41.94%		

## ●2024年5月28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、引き続き邦銀業態を中心に堅調な資金調達ニーズが見られているため、レート水準についても変化はなく、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、0.035~0.055%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>

28日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の業態で大型発行が散見された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

本日、CP買入オペが予定通りオファー額3,000億円で実施され、結果は按分レート0.161%、平均レート0.177%と前回(按分0.154%、平均0.176%)比で、按分レート、平均レート共に上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2024/5/28	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					-	0.045
T/N								-	0.041
S/N								-	-
1W								-	0.055
2W			0.150					-	0.057
3W								-	0.058
1M			0.160					-	0.057
3M			0.200					0.015	0.082
6M								0.080	0.110
1Y								0.195	0.193

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)
1.035	+0.015		38,855.37	▲ 44.65		156.83-85	156.88-90
日付	5/21	5/22	5/23	5/24	5/27		
日銀当預残	5,515,100	5,517,800	5,521,900	5,537,000	5,524,600		
準備預金残	4,863,600	4,859,500	4,872,900	4,879,700	4,885,600		
マネタリーベース	6,760,000	6,762,300	6,766,300	6,781,100	6,768,300		
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.078%	0.078%		
コール市場残高	117,300	115,883	117,743	118,163	114,703		
うち無担	79,628	77,714	78,138	78,600	75,707		
うちO/N	38,080	35,526	35,345	35,247	32,154		
うち有担	37,672	38,169	39,605	39,563	38,996		

## ●入札結果

名称	回数	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)	非競争入札(億円)
GX10年利付国債	2	1.0%	3,500	2024/5/29	2034/3/20	11,007	3,496	99.63	1.040%	22.8873%				
交付税特会	-	-	13,000	2024/6/4	2024/12/4	40,500	12,990		0.200%	38.6960%		0.148%		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		2024/5/30	2024/6/6	5.580	0	0				
CP等買入	3,000	2024/5/31			6,196	2,995	0.161		0.177	97.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/5/28	2024/5/29	▲0.250	29,530	29,530		▲0.250	▲0.250	
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	8,000	2024/5/29	2024/6/12	0.100	7,159	7,159				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/28	2024/5/29	▲0.250	10	10		▲0.250	▲0.250	

## ●2024年5月29日の予定

\*熊本県金融経済懇談会において安達日銀審議委員講演  
\*5月の消費動向調査

\*米ページブック

◆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