

# Central Daily Market Report

2024年5月30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30日 需給速報	2024年5月31日 需給予想	2024年6月3日 当社予想			
銀行券	600	400	500			
財政	▲ 900	▲ 5,200	▲ 28,500			
資金過不足	▲ 300	▲ 4,800	▲ 28,000			
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						
CP等買入		3,000	▲ 2,300			
貸出支援基金(成)						▲ 2,000
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	▲ 30,300	28,500		30,300		
当増減	▲ 2,100		26,200		▲ 30,000	
当座預金残高	5,521,200		5,547,400		5,517,400	
準備預金残高	4,867,600					
積み終了先	4,866,700			5月31日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,866,700			積数	5,200	
非準備預金先	653,600			1日平均	300	
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	99.87%	日数	48.39%		

## ●2024年5月30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、0~0.04%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>

30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

2024/5/30	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	0.125	0.077				-	0.039
T/N							-	0.033
S/N							-	-
1W	0.110	0.125	0.120				-	0.055
2W	0.100	0.180	0.138				-	0.058
3W							-	0.058
1M			0.130				-	0.057
3M							0.019	0.083
6M							0.070	0.122
1Y							0.195	0.199

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)		
1.055	▲ 0.020	38,054.13	▲ 502.74	157.62-64	156.96-98		
日付	5/23	5/24	5/27	5/28	5/29		
日銀当預残	5,521,900	5,537,000	5,524,600	5,533,800	5,523,300		
準備預金残	4,872,900	4,879,700	4,885,600	4,877,600	4,877,900		
マネタリーベース	6,766,300	6,781,100	6,768,300	6,777,000	6,766,200		
無担O/N加重平均	0.077%	0.078%	0.078%	0.077%	0.078%		
コール市場残高	117,743	118,163	114,703	113,656	116,555		
うち無担	78,138	78,600	75,707	74,804	76,749		
うちO/N	35,345	35,247	32,154	31,234	33,079		
うち有担	39,605	39,563	38,996	38,852	39,806		

## ●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)
2年利付国債	461	0.4%	26,000	2024/6/3	2026/6/1	75,614	20,019	99.955	0.422%	78.2481%	99.964	0.418%	5,971

## ●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)		2024/5/30	2024/5/31	▲0.150	31,250	31,250		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/30	2024/5/31	▲0.150	0	0				

## ●2024年5月31日の予定

*5月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+1.9%)	*4月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1234回)入札 (3ヶ月、58,000億円、6/3発行)
*4月の完全失業率(市場予想:2.6%)	*5月のシカゴPM景況感指数	
*4月の有効求人倍率(市場予想:1.28倍)	*5月のユーロ圏消費者物価指数速報値	
*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.9%)		
*4月の商業動態統計速報		
*4月の住宅着工統計		

◆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