

Central Daily Market Report

2024年5月31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31日 需給速報	2024年6月3日 需給予想	2024年6月4日 当社予想			
銀行券	400	900	700			
財政	▲ 9,500	▲ 64,600	▲ 38,000			
資金過不足	▲ 9,100	▲ 63,700	▲ 37,300			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,900			
CP等買入	3,000	▲ 2,300				
貸出支援基金(成)				▲ 1,600		
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						
国債補充供給	▲ 27,800	30,300		27,800		
当預増減	▲ 5,900	▲ 26,700	▲ 37,300			
当座預金残高	5,515,300	5,488,600	5,451,300			
準備預金残高	4,848,000					
積み終了先	4,847,400			6月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,847,400			積数	3,300	
非準備預金先	667,300			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	99.92%	日数	58.06%		

●2024年5月31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、0.05~0.08%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>

31日はTB3M物(第1234回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。この他6M物、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は案件が少なく閑散としたマーケットとなった。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

2024/5/31	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	売買参考統計値	平均値
O/N	0.060	0.079	0.077				-	0.018
T/N							-	0.071
S/N							-	-
1W							-	0.056
2W			0.170				-	0.058
3W							-	0.057
1M			0.220				-	0.057
3M							0.030	0.085
6M							0.060	0.127
1Y							0.204	0.200

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)
1.070	+0.015		38,487.90	+433.77		156.98-00	157.14-15
日付	5/24	5/27	5/28	5/29	5/30		
日銀当預残	5,537,000	5,524,600	5,533,800	5,523,300	5,521,200		
準備預金残	4,879,700	4,885,600	4,877,600	4,877,900	4,867,600		
マネタリーベース	6,781,100	6,768,300	6,777,000	6,766,200	6,763,500		
無担O/N加重平均	0.078%	0.078%	0.077%	0.078%	0.077%		
コール市場残高	118,163	114,703	113,656	116,555	115,755		
うち無担	78,600	75,707	74,804	76,749	76,284		
うちO/N	35,247	32,154	31,234	33,079	32,344		
うち有担	39,563	38,996	38,852	39,806	39,471		

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1234	-	58,000	2024/6/3	2024/9/2	156,754.8	44,040.4	99.9905	0.0381%	15.7949%	99.9921	0.0316%	13,959

●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3年超5年以下)	4,250	2024/6/3			9,930	4,256	0.000		0.000	98.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2024/6/3			9,879	4,257	0.003		0.007	32.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/6/3			3,751	1,504	0.021		0.022	32.9
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/6/3			2,303	754	0.030		0.031	5.2
国債買入(物価連動債)	600	2024/6/3			2,671	601	▲0.070		▲0.192	6.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/5/31	2024/6/3	▲0.250	28,611	28,611		▲0.250	▲0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/31	2024/6/3	▲0.250	0	0				

●2024年6月3日の予定

*1-3月期の法人企業統計調査季報

*5月のISM製造業景況指数

*4月の米建設支出

◆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