

# Central Daily Market Report

2024年5月14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14日 需給速報	2024年5月15日 需給予想	2024年5月16日 当社予想
銀行券	1,500	1,100	1,500
財政	▲ 3,400	▲ 25,300	1,000
資金過不足	▲ 1,900	▲ 24,200	2,500

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			7,000	▲ 6,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,400					
CP等買入		▲ 400		▲ 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						
国債補完供給	▲ 33,900	35,200		33,900		

当預増減	8,400	9,700	2,500
------	-------	-------	-------

当座預金残高	5,528,000	5,537,700	5,540,200
準備預金残高	4,880,200		
積み終了先	4,880,200		
超過準備	4,880,200		
非準備預金先	647,800		

積み期間(4/16~5/15)の所要準備額			3,961,600
-----------------------	--	--	-----------

準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.67%
---------	----	---------	----	--------

## ●2024年5月14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、邦銀業態から資金調達ニーズが根強くみられたことで、出合い水準は変動無く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、0.075~0.085%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>

14日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物と1Y物で出合いが見られた。

### <CP市場>

本日は数件の発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

また本日は、CP等買入オペが事前予定通り3,000億円に減額されてオフアされた。結果は按分レート0.154%、平均レート0.176%と、前回(按分0.120%、平均0.154%)比で、按分、平均ともに上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2024/5/14	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	売買参考値	平均値
O/N	0.070	0.078	0.077				-	0.076
T/N							-	0.080
S/N							-	-
1W							-	0.068
2W			0.170				-	0.061
3W			0.140				-	0.059
1M							-	0.058
3M			0.190				0.030	0.063
6M							0.095	0.087
1Y							0.185	0.129

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)
0.958	+0.023	38,356.06	+176.60	156.23-25	156.45-47
日付	5/7	5/8	5/9	5/10	5/13
日銀当預残	5,549,900	5,567,100	5,536,900	5,534,300	5,519,600
準備預金残	4,897,200	4,905,200	4,882,800	4,877,000	4,872,300
マネタリーベース	6,809,000	6,823,500	6,791,200	6,786,400	6,770,000
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	115,792	126,883	125,206	116,058	120,043
うち無担	77,640	88,159	87,065	78,412	83,133
うちO/N	35,117	46,101	45,167	37,439	42,115
うち有担	38,152	38,724	38,141	37,646	36,910

## ●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	168	0.6%	23,000	2024/5/15	2029/3/20	67,747	17,385	100.09	0.580%	3.3552%	100.13	0.572%	5,608	-
交付税特会	-	-	13,000	2024/5/22	2024/11/22	51,774	12,990.01		0.120%	32.6157%		0.116%		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		2024/5/16	2024/5/23	5.580	1	1				
CP等買入	3,000	2024/5/17			6,970	2,995	0.154		0.176	93.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/5/14	2024/5/15	▲0.150	34,748	34,748		▲0.150	▲0.150	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/5/15	2024/5/29	0.100	6,960	6,960				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/14	2024/5/15	▲0.150	0	0				

## ●2024年5月15日の予定

*4月の米消費者物価指数	*4月の米小売売上高	*3月の米企業在庫	*1-3月期のユーロ圏GDP2次速報
--------------	------------	-----------	--------------------

◆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