

●資金需給

単位：億円	2024年5月2日 需給速報		2024年5月7日 需給予想		2024年5月8日 当社予想					
銀行券	▲ 300		1,300		3,000					
財政	▲ 31,700		▲ 43,600		▲ 1,000					
資金過不足	▲ 32,000		▲ 42,300		2,000					
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		▲ 300		▲ 100						
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	▲ 32,600	34,800		32,600						
※ドル資金供給用国債国債供給										
当預増減	▲ 30,100		▲ 9,800		2,000					
当座預金残高	5,592,700		5,582,900		5,584,900					
準備預金残高	4,916,500		5月7日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>200</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				積数	200	1日平均	0
積数	200									
1日平均	0									
積み終了先	4,916,400									
超過準備	4,916,400									
非準備預金先	676,200									
積み期間（4/16～5/15）の所要準備額					3,955,000					
準備預金進捗率	実績		99.99%	日数	70.00%					

●2024年5月2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資金調達ニーズが強く、出合い水準は0.070~0.078%程度で推移した。
本日連休前5日積みとなり、前日比でさらに強含む場面も見られた。
ターム物は、一部業態による調達が散見された。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.06~0.105%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＞
2日はTB3M物(第1228回)の入札が実施され、やや甘めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、軟調に推移した。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数の業態で発行が実施された。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

2024/5/2	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	売買参考値	平均値
O/N	0.060	0.079	0.077				-	0.068
T/N							-	0.075
S/N							-	-
1W							-	0.049
2W							-	0.043
3W							-	0.043
1M	0.160	0.190	0.173				-	0.044
3M	0.200	0.210	0.207				0.033	0.051
6M							0.050	0.076
1Y							0.130	0.115

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)
0.900	+0.010	38,236.07	▲ 37.98	155.70~72	155.48~51

日付	4/24	4/25	4/26	4/30	5/1
日銀当預残	5,701,300	5,700,000	5,699,600	5,703,400	5,622,800
準備預金残	5,007,500	5,004,100	5,010,700	5,021,700	4,951,000
マネタリーベース	6,957,300	6,957,100	6,957,900	6,962,600	6,882,700
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%
コール市場残高	114,895	115,617	115,077	116,554	117,000
うち無担	78,557	78,302	79,366	85,556	80,673
うちO/N	34,364	33,759	35,843	42,473	36,340
うち有担	36,338	37,315	35,711	30,998	36,327

●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	1228	-	58,000	2024/5/7	2024/8/5	129,306	44,145.5	99.9915	0.0344%	67.4659%	99.9936	0.0259%	13,854
流動性供給	405	-	5,000	2024/5/7	-	17,917	4,982		▲0.007%	46.7361%		▲0.008%	

●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)		2024/5/2	2024/5/7	▲0.250	33,252	33,252		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/2	2024/5/7	▲0.250	0	0				

●2024年5月3日の予定

*憲法記念日	*4月の米雇用統計	*4月のISM非製造業景況指数
--------	-----------	-----------------

●2024年5月6日の予定

*振替休日	*London祝日(Early May bank holiday)
-------	-----------------------------------

●2024年5月7日の予定

*5月の日銀当座預金増減要因見込み	*3月の米消費者信用残高
-------------------	--------------

◆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論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