

●資金需給

単位：億円	2024年5月13日 需給速報		2024年5月14日 需給予想		2024年5月15日 当社予想	
銀行券	1,700		1,400		2,000	
財政	▲ 15,600		▲ 6,000		▲ 24,000	
資金過不足	▲ 13,900		▲ 4,600		▲ 22,000	
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						▲ 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		
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	▲ 35,200	34,400		35,200		
※ドル資金供給用信託国債供給						
当預増減	▲ 14,700		39,600		▲ 28,500	
当座預金残高	5,519,600		5,559,200		5,530,700	
準備預金残高	4,872,300					
積み終了先	4,872,300				5月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,872,300				積数	0
非準備預金先	647,300				1日平均	0
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	93.33%

●2024年5月13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、3日積み要因が剥落したものの引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズの根強い展開となった事から、出合い水準に大きな変動はみられず、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、0.075～0.08%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＞

13日のアウトラ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発行市場は大型発行を含め、複数の業態で発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/5/13	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 （億円）	平均値
O/N	0.065	0.078	0.077				－	0.079
T/N							－	0.079
S/N							－	－
1W							－	0.068
2W	0.170	0.179	0.173				－	0.062
3W			0.170				－	0.059
1M			0.190				－	0.058
3M							0.030	0.063
6M							0.081	0.085
1Y							0.145	0.125

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）
0.935	+0.030	38,179.46	▲ 49.65	155.82-85	155.88-89

日付	5/2	5/7	5/8	5/9	5/10
日銀当預残	5,592,700	5,549,900	5,567,100	5,536,900	5,534,300
準備預金残	4,916,300	4,897,200	4,905,200	4,882,800	4,877,000
マネタリーベース	6,853,000	6,809,000	6,823,500	6,791,200	6,786,400
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	119,849	115,792	126,883	125,206	116,058
うち無担	83,170	77,640	88,159	87,065	78,412
うちO/N	39,407	35,117	46,101	45,167	37,439
うち有担	36,679	38,152	38,724	38,141	37,646

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札 （億円）
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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1年超3年以下）	3,750	2024/5/14			7,070	3,760	0.008		0.009	91.5
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,250	2024/5/14			9,606	4,257	0.025		0.028	52.8
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,500	2024/5/14			4,369	1,502	0.030		0.031	93.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/5/13	2024/5/14	▲0.150	35,967	35,967		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/5/13	2024/5/14	▲0.150	0	0				

●2024年5月14日の予定

*4月の企業物価指数 *3月の特定サービス産業動態統計速報	*4月の米生産者物価指数	*5年利付国債入札 （23,000億円、5/15発行） *交付税特別会計借入 （13,000億円、5/22借入）
----------------------------------	--------------	---

◆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ものがあります。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