

●資金需給

単位：億円	2024年5月22日 需給速報		2024年5月23日 需給予想		2024年5月24日 当社予想	
銀行券	400		200		▲ 1,000	
財政	300		8,000		1,000	
資金過不足	700		8,200		0	
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		▲ 800				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100			800	
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 27,900	30,800		27,900		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	2,700		36,100		800	
当座預金残高	5,517,800		5,553,900		5,554,700	
準備預金残高	4,859,500					
積み終了先	4,857,400		5月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,857,400		積数		15,800	
非準備預金先	658,300		1日平均		700	
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		99.61%	日数	22.58%	

●2024年5月22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、引き続き邦銀業態から資金調達ニーズが堅調にみられたことで、出合い水準は変わりなく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、0.06～0.08%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＞
22日のアウトラ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実施され、一部の業態では大型発行が実施された。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

2024/5/22	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	0.065	0.078	0.077				－	0.071
T/N							－	0.062
S/N							－	－
1W							－	0.061
2W							－	0.062
3W							－	0.060
1M							－	0.059
3M							0.035	0.075
6M							0.080	0.099
1Y							0.195	0.174

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)
0.995	+0.015	38,617.10	▲ 329.83	156.26-29	156.40-41

日付	5/15	5/16	5/17	5/20	5/21
日銀当預残	5,505,100	5,502,100	5,498,000	5,517,200	5,515,100
準備預金残	4,864,000	4,845,600	4,847,300	4,871,400	4,863,600
マネタリーベース	6,752,800	6,748,900	6,743,900	6,762,700	6,760,000
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	121,702	110,510	112,192	115,333	117,300
うち無担	83,666	72,570	74,293	77,471	79,628
うちO/N	43,128	31,832	33,465	36,023	38,080
うち有担	38,036	37,940	37,899	37,862	37,672

●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)
40年利付国債	17	2.2%	7,000	2024/5/23	2064/3/20	15,422	6,994	98.17	2.270%	26.3829%			

●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)		2024/5/22	2024/5/23	▲0.250	28,646	28,646		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/22	2024/5/23	▲0.250	0	0				

●2024年5月23日の予定

*4月の米新築一戸建て販売件数	*交付税特別会計借入 (13,000億円、5/31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