

●資金需給

単位：億円	2024年5月27日 需給速報		2024年5月28日 需給予想		2024年5月29日 当社予想	
銀行券	400		500		1,500	
財政	▲ 11,700		8,800		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 11,300		9,300		▲ 6,500	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 600		
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				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 28,000	27,200		28,000		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 12,400		36,700		▲ 13,500	
当座預金残高	5,524,600		5,561,300		5,547,800	
準備預金残高	4,885,600					
積み終了先	4,884,500		5月28日以降の残り所要積立額 積数 7,900 1日平均 400			
超過準備	4,884,300					
非準備預金先	639,000					
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 99.81%		日数		38.71%	

●2024年5月27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、0.03～0.07%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＞
27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観測され、一部で大型発行も見られた。
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

2024/5/27	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	売買参考統計値	平均値
O/N	0.070	0.125	0.078				－	0.060
T/N							－	0.048
S/N							－	－
1W			0.240				－	0.060
2W			0.150				－	0.060
3W							－	0.060
1M	0.150	0.180	0.156				－	0.059
3M							0.015	0.079
6M							0.080	0.107
1Y							0.195	0.189

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)
1.020	+0.015	38,900.02	+253.91	156.84-87	156.90-93

日付	5/20	5/21	5/22	5/23	5/24
日銀当預残	5,517,200	5,515,100	5,517,800	5,521,900	5,537,000
準備預金残	4,871,400	4,863,600	4,859,500	4,872,900	4,879,700
マネタリーベース	6,762,700	6,760,000	6,762,300	6,766,300	6,781,100
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.078%
コール市場残高	115,333	117,300	115,883	117,743	118,163
うち無担	77,471	79,628	77,714	78,138	78,600
うちO/N	36,023	38,080	35,526	35,345	35,247
うち有担	37,862	37,672	38,169	39,605	39,563

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/5/27	2024/5/28	▲0.150	28,803	28,803		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/5/27	2024/5/28	▲0.150	50	50		▲0.150	▲0.150	

●2024年5月28日の予定

*4月の企業向けサービス価格指数	*3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 *5月の米CB消費者信頼感指数	*GX10年利付国債入札 （3,500億円、5/29発行） *交付税特別会計借入 （13,000億円、6/4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