

●資金需給

単位：億円	2024年5月29日 需給速報		2024年5月30日 需給予想		2024年5月31日 当社予想	
銀行券	300		600		▲ 500	
財政	▲ 10,700		700		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 10,400		1,300		▲ 12,500	
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	7,200	▲ 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		▲ 500			3,000	
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	▲ 28,500	28,700		28,500		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 10,500		29,800		▲ 9,500	
当座預金残高	5,523,300		5,553,100		5,543,600	
準備預金残高	4,877,900					
積み終了先	4,877,000				5月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,877,000				積数	6,000
非準備預金先	645,400				1日平均	400
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		99.85%	日数	45.16%	

●2024年5月29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、0.04～0.06%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＞
29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発行市場は月末発行にあたり、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推移した。

●短期金融市場関連指標

2024/5/29	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	0.070	0.145	0.078				－	0.047
T/N							－	0.051
S/N							－	－
1W			0.118				－	0.057
2W							－	0.058
3W							－	0.058
1M			0.200				－	0.058
3M			0.200				0.015	0.083
6M							0.075	0.117
1Y							0.195	0.195

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)
1.075	+0.040	38,556.87	▲ 298.50	157.26-28	157.12-14

日付	5/22	5/23	5/24	5/27	5/28
日銀当預残	5,517,800	5,521,900	5,537,000	5,524,600	5,533,800
準備預金残	4,859,500	4,872,900	4,879,700	4,885,600	4,877,600
マネタリーベース	6,762,300	6,766,300	6,781,100	6,768,300	6,777,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.078%	0.078%	0.077%
コール市場残高	115,883	117,743	118,163	114,703	113,656
うち無担	77,714	78,138	78,600	75,707	74,804
うちO/N	35,526	35,345	35,247	32,154	31,234
うち有担	38,169	39,605	39,563	38,996	38,852

●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)		2024/5/29	2024/5/30	▲0.250	29,270	29,270		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/5/29	2024/5/30	▲0.250	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化 米ドル特則第40期(借り換え)	2024/6/3	2025/6/3		2,483	14
成長基盤強化 米ドル特則第36期(借り換え)	2024/6/3	2025/6/3		2,835	15

●2024年5月30日の予定

*2年利付国債入札 (26,000億円、6/3発行)	*1-3月期の米GDP改定値
-------------------------------	----------------

◆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