

Central Daily Market Report

2022年5月19日(木)
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2022年5月19日 需給速報	2022年5月20日 需給予想	2022年5月23日 当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 200	▲ 1,000
財政	▲ 24,100	10,800	▲ 15,000
資金過不足	▲ 24,200	10,600	▲ 16,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		10,300	
CP等買入		▲ 200	▲ 300
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
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補充供給	▲ 1,400	6,100	1,400
※ドル資金需給速報は別途発表			
当増減	▲ 19,700	21,900	▲ 16,000
当座預金残高	5,527,800	5,549,700	5,533,700
準備預金残高	4,847,400		
積み終了先	4,842,800		5月20日以降の残り所要積立額
超過準備	4,841,000		積数
非準備預金先	680,400		1日平均
			400
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額			3,873,000
準備預金進捗率	実績	99.74%	日数
			12.90%

●2022年5月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.037~▲0.005%の調達で始まり、前日から大きな変化は見られなかった。一巡後は▲0.028~▲0.018%近辺での出合いが散見された。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.10%程度での出合い。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>

19日はTB1Y物(第1080回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で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

2022/5/19 単位：%	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円		
	最低	最高	平均	最低	最高	平均			直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.098	0.240	0.000	26,402.84	▲ 508.36	127.92-93	128.22-23	
T/N	▲ 0.013	▲ 0.011	▲ 0.012				-	▲ 0.107							
S/N			▲ 0.003				-	-							
1W			0.000				-	▲ 0.112							
2W							-	▲ 0.113							
3W	▲ 0.020	▲ 0.012	▲ 0.015				-	▲ 0.116							
1M	▲ 0.015	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.121							
3M							▲ 0.130	▲ 0.121							
6M							▲ 0.105	▲ 0.114							
1Y							▲ 0.102	▲ 0.111							
									日付		5/12	5/13	5/16	5/17	5/18
									日銀当預残	5,547,800	5,541,100	5,543,200	5,544,000	5,547,500	
									準備預金残	4,872,800	4,881,200	4,862,200	4,863,700	4,861,300	
									マネタリーベース	6,799,200	6,790,600	6,791,300	6,790,900	6,794,100	
									無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.005%	▲0.019%	▲0.018%	▲0.019%	
									コール市場残高	171,911	160,122	198,441	206,362	212,472	
									うち無担	141,164	130,047	168,687	176,040	182,499	
									うちO/N	73,341	63,234	97,899	98,792	103,691	
									うち有担	30,747	30,075	29,754	30,322	29,973	

●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1非償還格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1080	-	35,000	2022/5/20	2023/5/22	137,625.0	28,307.9	100.0810	▲0.0804%	36.9716%	100.0890	▲0.0884%	6,692.0	
交付税特会	-	-	13,000	2022/5/31	2022/11/30	496,587.0	12,990.66	-	0.0000%	2.6160%	-	0.0000%		10.00

●オベ結果

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)	4,750	2022/5/20			9,823	4,755	0.001		0.002	13.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/5/20			14,816	5,007	▲0.003		▲0.002	45.2
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/5/20			2,518	504	▲0.003		▲0.002	34.5
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2022/5/19	2022/5/20	▲ 0.350	1,385	1,385		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先・即日(午後オファー分))		2022/5/19	2022/5/20	▲ 0.350	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/5/20			0	0				

※国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.010%。この結果、10年利付国債366回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年5月20日の予定

*4月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.1%	*国庫短期証券(1081回)入札 (3ヶ月、59,000億円、5/23発行) *20年利付国債入札 (12,000億円、5/23発行)
◆本資料は信頼できると思わ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録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	