

Central Daily Market Report

2022年5月20日(金)
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20日 需給速報	2022年5月23日 需給予想	2022年5月24日 当社予想
銀行券	▲ 200	500	▲ 1,000
財政	9,500	▲ 15,300	1,000
資金過不足	9,300	▲ 14,800	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	10,300					
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
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	1,400		1,400		
※ドル資金供給用国債買入						
当増減	19,200		▲ 13,600			0

当座預金残高	5,547,000	5,533,400	5,533,400	
準備預金残高	4,863,500			
積み終了先	4,862,600			
超過準備	4,861,800			
非準備預金先	683,500			
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	99.88%	日数	22.58%

●短期金融市場関連指標

2022/5/20 単位：%	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.099
T/N	▲ 0.013	▲ 0.011	▲ 0.012				-	▲ 0.105
S/N							-	-
1W			0.000				-	▲ 0.108
2W			▲ 0.019				-	▲ 0.112
3W							-	▲ 0.115
1M	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.119
3M							▲ 0.125	▲ 0.121
6M							▲ 0.110	▲ 0.114
1Y							▲ 0.105	▲ 0.111

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)	
0.235	▲ 0.005	26,739.03	336.19	127.84-86	127.92-94	
日付		5/13	5/16	5/17	5/18	5/19
日銀当預残	5,541,100	5,543,200	5,544,000	5,547,500	5,527,800	
準備預金残	4,881,200	4,862,200	4,863,700	4,861,300	4,847,400	
マネタリーベース	6,790,600	6,791,300	6,790,900	6,794,100	6,774,500	
無担O/N加重平均	▲ 0.005%	▲ 0.019%	▲ 0.018%	▲ 0.019%	▲ 0.019%	
コール市場残高	160,122	198,441	206,362	212,472	219,584	
うち無担	130,047	168,687	176,040	182,499	189,658	
うちO/N	63,234	97,899	98,792	103,691	110,840	
うち有担	30,075	29,754	30,322	29,973	29,926	

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1081	-	59,000	2022/5/23	2022/8/22	134,467.0	47,713.8	100.0290	▲ 0.1162%	54.1000%	100.0302	▲ 0.1210%	11,286.0
20年利付国債	180	0.80%	12,000	2022/5/23	2042/3/20	36,306.0	9,643.0	100.7000	0.7590%	68.5886%	100.7400	0.7570%	2,346.0

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/20	2022/5/23	▲ 0.350	1,399	1,399		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/20	2022/5/23	▲ 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)※		2022/5/23			0	0				
社債等買入	1,000	2022/5/25			2,530	1,000	0.157		0.166	96.4

※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23日の予定

*特にありません

◆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