

Central Daily Market Report

2022年5月24日(火)
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24日 需給速報	2022年5月25日 需給予想	2022年5月26日 当社予想
銀行券	100	0	▲ 1,000
財政	1,700	4,800	14,000
資金過不足	1,800	4,800	13,000

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			5,300	▲ 5,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			1,000	▲ 200		
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						
国債補完供給	▲ 3,300	1,800		3,300		
米ドル資金供給(国債補完供給)						
当増減	100		9,000		13,000	

当座預金残高	5,532,700	5,541,700	5,554,700
準備預金残高	4,851,000		
積み終了先	4,850,600	5月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,850,600	積数	3,300
非準備預金先	681,700	1日平均	100

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 99.91% 日数 29.03%

●2022年5月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.038~▲0.008%での調達で始まった。前日比でレート水準に大きな変化は見られず、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.095%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>

24日はTB6M物(第1082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、しっかり推移した。この他、3M物と1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/5/24 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	▲ 0.020				-	▲ 0.099	0.230	▲ 0.005	26,748.14	▲ 253.38	127.80-82	127.27-29
T/N			▲ 0.011				-	▲ 0.105						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.125	▲ 0.118						
6M							▲ 0.117	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.112						

日付	5/17	5/18	5/19	5/20	5/23
日銀当預残	5,544,000	5,547,500	5,527,800	5,547,000	5,532,600
準備預金残	4,863,700	4,861,300	4,847,400	4,863,500	4,850,000
マネタリーベース	6,790,900	6,794,100	6,774,500	6,793,800	6,778,900
無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.019%	▲0.019%	▲0.020%	▲0.021%
コール市場残高	206,362	212,472	219,584	217,901	212,726
うち無担	176,040	182,499	189,658	187,530	182,033
うちO/N	98,792	103,691	110,840	115,697	103,060
うち有担	30,322	29,973	29,926	30,371	30,693

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1082	-	32,000	2022/5/25	2022/11/25	118,734.0	25,883.6	100.0540	▲0.1070%	90.8094%	100.0560	▲0.1110%	6,116	-
流動性供給	358	-	5,000	2022/5/25	-	21,556.0	4,977.0	-	▲0.0070%	78.0638%	-	▲0.0070%	-	-
交付税特会	-	-	13,000	2022/6/2	2022/12/2	505,554.0	12,990.00	-	0.0000%	2.5695%	-	0.0000%	-	10.00

●オペ結果

種類	オフア一額(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(午前オフア一)		2022/5/24	2022/5/25	▲ 0.350	3,244	3,244		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア一)		2022/5/24	2022/2/25	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/5/26	2022/6/2	1.080	0	0				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2022/5/25	2022/6/8		5,250	5,250				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/5/25			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、0.015%。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ア一。

●2022年5月25日の予定

*日本銀行金融研究所主催 2022年国際コンファランスにおいて黒田総裁講演	*4月の米耐久財新規受注
*月例経済報告	
*3月の景気動向指数改訂状況	

◆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