

# Central Daily Market Report

2022年5月25日(水)  
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25日 需給速報	2022年5月26日 需給予想	2022年5月27日 当社予想	
銀行券	0	▲ 1,000	▲ 1,000	
財政	5,600	13,000	3,000	
資金過不足	5,600	12,000	2,000	
<b>金融調節</b>				
	スタート	エンド	スタート	
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		16,300		
CP等買入		▲ 100	▲ 500	
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		
新型コロナウイルス対応金融支援特別			▲ 69,200	
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補充供給	▲ 2,700	3,300	2,700	
※ドル資金需給速報は前日速報を参照				
当増減	7,100	30,500	▲ 67,200	
当座預金残高	5,539,800	5,570,300	5,503,100	
準備預金残高	4,858,400			
積み終了先	4,858,000	5月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,858,000	積数	2,900	
非準備預金先	681,400	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	99.93%	日数	32.26%

## ●2022年5月25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▲0.045~▲0.008%での調達で始まった。前日比でレート水準は若干低下し、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、▲0.110~▲0.100%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>

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、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

2022/5/25 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				-	▲ 0.100	0.205	▲ 0.025	26,677.80	▲ 70.34	126.73-75	127.11-13	
T/N			▲ 0.012				-	▲ 0.106							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.023				-	▲ 0.108							
2W	▲ 0.025	▲ 0.008	▲ 0.017				-	▲ 0.112							
3W			0.100				-	▲ 0.114							
1M							-	▲ 0.119							
3M							▲ 0.125	▲ 0.118							
6M							▲ 0.116	▲ 0.114							
1Y							▲ 0.115	▲ 0.113							
										日付	5/18	5/19	5/20	5/23	5/24
										日銀当預残	5,547,500	5,527,800	5,547,000	5,532,600	5,532,700
										準備預金残	4,861,300	4,847,400	4,863,500	4,850,000	4,851,000
										マネタリーベース	6,794,100	6,774,500	6,793,800	6,778,900	6,778,900
										無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.019%	▲ 0.020%	▲ 0.021%	▲ 0.020%
										コール市場残高	212,472	219,584	217,901	212,726	218,276
										うち無担	182,499	189,658	187,530	182,033	188,198
										うちO/N	103,691	110,840	115,697	103,060	100,245
										うち有担	29,973	29,926	30,371	30,693	30,078

## ●入札結果

名称	回数	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	募入最高利回り	棄分率	募入平均価格	募入平均利回り	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	応募総額(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	2022/5/26			9,113	4,751	▲ 0.005		▲ 0.003	39.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/5/26			11,653	4,756	▲ 0.013		▲ 0.012	79.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/5/26			9,770	5,005	▲ 0.023		▲ 0.021	54.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/5/26			5,407	1,265	▲ 0.020		▲ 0.018	4.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/25	2022/5/26	▲ 0.350	2,626	2,626		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/25	2022/5/26	▲ 0.350	84	84		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/5/26			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、0.020%。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26日の予定

*4月の企業向けサービス価格指数	*1-3月期の米GDP改定値	*40年利付国債入札(7,000億円、5/27発行)
------------------	----------------	----------------------------

◆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