Central Daily Market Report

2022年5月26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26日 需給速報	2022年5月27日 需給予想	2022年5月30日 当社予想
銀行券	▲ 1,100	▲ 200	1,000
財政	13,400	1,300	▲ 31,000
資金過不足	12,300	1,100	▲ 30,000

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	16,300					
CP等買入		▲ 500		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別			3,000	▲ 69,200		
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 3,300	2,700		3,300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	27,500		▲ 57,000		▲ 30,000	

当座預金残高	5,567,300	5,510,300	5,480,300
準備預金残高	4,890,500		
積み終了先	4,890,100		
超過準備	4,890,100		
非準備預金先	676,800		

5月27日以降の残り所要積立額	
積数	2,500
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	99.94%	日数 35.48%

●2022年5月26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>

26日は短国買入オペが前回と同額の5,000億円でオファーされ、やや甘めな結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<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。また、本日はCP等買入オペが4,000億円実施され、按分レートは▲0.002%だった。

●短期金融市場関連指標

2022/5/26	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	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.019				－	▲ 0.100
T/N	▲ 0.025	▲ 0.012	▲ 0.021				－	▲ 0.101
S/N			▲ 0.005				－	－
1W	▲ 0.018	0.000	▲ 0.013				－	▲ 0.106
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.022				－	▲ 0.110
3W							－	▲ 0.112
1M	▲ 0.040	▲ 0.013	▲ 0.031				－	▲ 0.119
3M							▲ 0.125	▲ 0.117
6M							▲ 0.113	▲ 0.114
1Y							▲ 0.115	▲ 0.114

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）
0.230	0.025	26,604.84	▲ 72.96	127.13-15	126.59-61

日付	5/19	5/20	5/23	5/24	5/25
日銀当預残	5,527,800	5,547,000	5,532,600	5,532,700	5,539,800
準備預金残	4,847,400	4,863,500	4,850,000	4,851,000	4,857,700
マネタリーベース	6,774,500	6,793,800	6,778,900	6,778,900	6,785,900
無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.020%	▲0.021%	▲0.020%	▲0.020%
コール市場残高	219,584	217,901	212,726	218,276	214,706
うち無担	189,658	187,530	182,033	188,198	184,397
うちO/N	110,840	115,697	103,060	100,245	91,879
うち有担	29,926	30,371	30,693	30,078	30,309

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
40年利付国債	15	1.000%	7,000	2022/5/27	2062/3/20	16,892.0	6,992.00	97.7400	1.0700%	53.1502%			

●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
国庫短期証券買入	5,000	2022/5/27			20,110	5,002	0.008		0.008	83.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/5/26	2022/5/27	▲ 0.350	3,270	3,270		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/5/26	2022/5/27	▲ 0.350	0	0				
CP等買入（注5）	4,000	2022/5/31			7,184	3,982	▲0.002		0.003	32.3
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※		2022/5/27			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、0.045%。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。

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
新型コロナ対応金融支援特別	制度融資分	2022/5/27	2022/11/30	0	1,908
新型コロナ対応金融支援特別	プロパー融資分	2022/5/27	2022/11/30	0	1,075

（参考）2022/5/27時点の貸出残高（億円）	
制度融資分(2022/4/1以降実行)	3,865
プロパー融資分(2022/4/1以降実行)	1,511
2022/3/31以前に実行された貸付け	740,906
合計	746,282

●2022年5月27日の予定

*5月の都区部消費者物価指数（CPI）
市場予想：前年同月比（除く生鮮）+2.0%

*4月の米個人所得・消費支出

*国庫短期証券（1083回）入札
（3ヶ月、59,000億円、5/30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論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