

Central Daily Market Report

2022年5月27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27日 需給速報	2022年5月30日 需給予想	2022年5月31日 当社予想	
銀行券	▲ 100	400	1,100	
財政	▲ 7,700	▲ 19,800	2,200	
資金過不足	▲ 7,800	▲ 19,400	3,300	
金融調節				
	スタート	エンド	スタート	
	スタート	エンド	スタート	
	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	5,000			
国債買入				
CP等買入		▲ 200	▲ 400	
4,000				
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	3,000	▲ 69,200		
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補充供給	▲ 1,400	3,300	1,400	
米ドル資金供給用国債供給				
当増減	▲ 67,300	▲ 18,500	7,300	
当座預金残高	5,500,000	5,481,500	5,488,800	
準備預金残高	4,821,800			
積み終了先	4,821,400			
超過準備	4,821,400			
非準備預金先	678,200			
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	99.97%	日数	45.16%

●2022年5月27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。週末3日積みの取引となったが、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、今週の取引を終えた。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、▲0.095～▲0.085%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＞

27日はTB3M物(第1083回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小甘く推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

＜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

2022/5/27	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円		
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高			平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.088	0.225	▲ 0.005	26,781.68	176.84	127.09-11	127.13-14	
T/N	▲ 0.018	▲ 0.012	▲ 0.015				-	▲ 0.092							
S/N			▲ 0.005				-	-							
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.100							
2W			0.001				-	▲ 0.103							
3W							-	▲ 0.109							
1M	▲ 0.008	0.200	0.022				-	▲ 0.117							
3M			0.016				▲ 0.096	▲ 0.117							
6M							▲ 0.110	▲ 0.114							
1Y							▲ 0.115	▲ 0.114							
									日付		5/20	5/23	5/24	5/25	5/26
									日銀当預残	5,547,000	5,532,600	5,532,700	5,539,800	5,567,300	
									準備預金残	4,863,500	4,850,000	4,851,000	4,857,700	4,890,300	
									マネタリーベース	6,793,800	6,778,900	6,778,900	6,785,900	6,814,500	
									無担O/N加重平均	▲0.020%	▲0.021%	▲0.020%	▲0.020%	▲0.019%	
									コール市場残高	217,901	212,726	218,276	214,706	221,434	
									うち無担	187,530	182,033	188,198	184,397	191,276	
									うちO/N	115,697	103,060	100,245	91,879	97,858	
									うち有担	30,371	30,693	30,078	30,309	30,158	

●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	1083	-	59,000	2022/5/30	2022/8/29	123,537.0	47,713.5	100.0245	▲0.0982%	41.3273%	100.0262	▲0.1050%	11,286.0

●オペ結果

種類	オフア額(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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/5/27	2022/5/30	▲ 0.350	1,395	1,395		▲ 0.350	▲ 0.035	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/5/27	2022/5/30	▲ 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)※		2022/5/30			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ア。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	2022/6/3	2026/6/3	0	3,160	23
成長基盤強化	2022/6/3	2026/6/2		2,558	17
成長基盤強化	2022/6/3	2026/6/2		3,085	17
成長基盤強化	2022/6/3	2026/6/2		59	15
成長基盤強化	2022/6/3	2026/6/2		146	12

●2022年5月30日の予定

*New York 祝日(Memorial Day)

◆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