Central Daily Market Report

2022年5月30日（月）
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30日 需給速報	2022年5月31日 需給予想	2022年6月1日 当社予想
銀行券	400	700	1,000
財政	▲ 21,700	▲ 3,400	▲ 25,000
資金過不足	▲ 21,300	▲ 2,700	▲ 24,000

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						
国債買入			11,000			
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 2,400		
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		▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 2,500	1,400		2,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 22,900		12,200		▲ 24,000	

当座預金残高	5,477,100	5,489,300	5,465,300
準備預金残高	4,801,500		
積み終了先	4,801,100	5月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,801,100	積数	900
非準備預金先	675,600	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 99.98%	日数	48.39%

●2022年5月30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▲0.04～▲0.012%での調達で始まった。先週末から大きな変化は見られず、前営業日比で概ね横ばいの推移となった。一巡後は▲0.06～▲0.013%前後の出合いが見られた。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.090～▲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>

30日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物と3M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/5/30	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	▲ 0.022				－	▲ 0.088
T/N	▲ 0.018	▲ 0.012	▲ 0.015				－	▲ 0.092
S/N			▲ 0.005				－	－
1W	▲ 0.035	▲ 0.019	▲ 0.029				－	▲ 0.100
2W	▲ 0.030	▲ 0.008	▲ 0.023				－	▲ 0.103
3W							－	▲ 0.107
1M			0.001				－	▲ 0.118
3M							▲ 0.099	▲ 0.113
6M							▲ 0.112	▲ 0.112
1Y							▲ 0.114	▲ 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)
0.230	0.005	27,369.43	587.75	127.26-28	127.35-37

日付	5/23	5/24	5/25	5/26	5/27
日銀当預残	5,532,600	5,532,700	5,539,800	5,567,300	5,500,000
準備預金残	4,850,000	4,851,000	4,857,700	4,890,300	4,821,800
マネタリーベース	6,778,900	6,778,900	6,785,900	6,814,500	6,747,300
無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.020%	▲0.020%	▲0.019%	▲0.021%
コール市場残高	212,726	218,276	214,706	221,434	239,417
うち無担	182,033	188,198	184,397	191,276	208,619
うちO/N	103,060	100,245	91,879	97,858	116,926
うち有担	30,693	30,078	30,309	30,158	30,798

●入札結果

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
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,750	2022/5/31			10,852	4,756	0.000		0.001	52.7
国債買入（残存期間5年超10年以下）	5,000	2022/5/31			13,406	5,017	0.000		0.000	83.7
国債買入（残存期間25年超）	500	2022/5/31			2,215	506	0.008		0.008	74.9
国債買入（物価連動債）	600	2022/5/31			1,987	600	▲0.300		▲0.422	90.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/5/30	2022/5/31	▲ 0.350	2,459	2,459		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/5/30	2022/5/31	▲ 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）※		2022/5/31			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、0.025%。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31日の予定

*4月の完全失業率（市場予想：2.6%）
*4月の有効求人倍率（市場予想：1.23倍）
*4月の商業動態統計速報
*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報
（市場予想：前月比▲0.2%）
*4月の住宅着工統計
*5月の消費動向調査
*3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*5月のシカゴPM景況感指数
*5月の米CB消費者信頼感指数
*5月のユーロ圏消費者物価指数速報値
*2年利付国債入札
（28,000億円、6/1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