

Central Daily Market Report

2022年5月23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23日 需給速報	2022年5月24日 需給予想	2022年5月25日 当社予想	
銀行券	500	200	▲ 1,000	
財政	▲ 14,300	1,200	4,000	
資金過不足	▲ 13,800	1,400	3,000	
金融調節				
	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通			▲ 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	▲ 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			1,000	
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				
国債補充供給	▲ 1,800	1,400	1,800	
※ドル資金供給用国債国債供給				
当預増減	▲ 14,400	3,000	▲ 1,100	
当座預金残高	5,532,600	5,535,600	5,534,500	
準備預金残高	4,850,200			
積み終了先	4,849,200	5月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,849,200	積数	3,700	
非準備預金先	682,400	1日平均	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	99.90%	日数	25.81%

●2022年5月23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。レート水準は前営業日比で若干低下し、一巡後も朝方と同水準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~▲0.095%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>

23日のアウトライト市場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。

●短期金融市場関連指標

2022/5/23 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	▲ 0.021				-	▲ 0.100	0.235	0.000	27,001.52	262.49	127.89-90	127.58-59
T/N			▲ 0.011				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.033	▲ 0.018	▲ 0.027				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.018	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.125	▲ 0.118						
6M							▲ 0.110	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.105	▲ 0.111						
									日付	5/16	5/17	5/18	5/19	5/20
									日銀当預残	5,543,200	5,544,000	5,547,500	5,527,800	5,547,000
									準備預金残	4,862,200	4,863,700	4,861,300	4,847,400	4,863,500
									マネタリーベース	6,791,300	6,790,900	6,794,100	6,774,500	6,793,800
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.018%	▲0.019%	▲0.019%	▲0.020%
									コール市場残高	198,441	206,362	212,472	219,584	217,901
									うち無担	168,687	176,040	182,499	189,658	187,530
									うちO/N	97,899	98,792	103,691	110,840	115,697
									うち有担	29,754	30,322	29,973	29,926	30,371

●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	募入最高額	募入率	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/23	2022/5/24	▲ 0.350	1,729	1,729		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/23	2022/5/24	▲ 0.350	73	73		▲ 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)※		2022/5/24			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ァー。

●2022年5月24日の予定

*4月の米新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(1082回)入札 (6ヶ月、32,000億円、5/25発行) *流動性供給入札 (5,000億円、5/25発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、6/2借入)
-----------------	---

◆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