

# Central Daily Market Report

2022年5月31日(火)  
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31日<br>需給速報 | 2022年6月1日<br>需給予想 | 2022年6月2日<br>当社予想 |                |           |     |
|-----------------------|--------------------|-------------------|-------------------|----------------|-----------|-----|
| 銀行券                   | 700                | 300               | 0                 |                |           |     |
| 財政                    | ▲ 2,600            | ▲ 54,800          | ▲ 59,000          |                |           |     |
| 資金過不足                 | ▲ 1,900            | ▲ 54,500          | ▲ 59,000          |                |           |     |
| 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                  | 11,000             |                   |                   |                |           |     |
| CP等買入                 | 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                 |                    | ▲ 200             |                   |                |           |     |
| 新型コロナウイルス対応金融支援特別     |                    |                   |                   |                |           |     |
| 気候変動対応オペ              |                    |                   |                   |                |           |     |
| E T F 買入              |                    |                   |                   |                |           |     |
| 国債補充供給                | ▲ 2,200            | 2,500             | 2,200             |                |           |     |
| 米ドル資金供給用国債供給          |                    |                   |                   |                |           |     |
| 当増減                   | 10,800             | ▲ 47,300          | ▲ 59,000          |                |           |     |
| 当座預金残高                | 5,487,900          | 5,440,600         | 5,381,600         |                |           |     |
| 準備預金残高                | 4,811,100          |                   |                   |                |           |     |
| 積み終了先                 | 4,810,700          |                   |                   | 6月1日以降の残り所要積立額 |           |     |
| 超過準備                  | 4,810,700          |                   |                   | 積数             | 500       |     |
| 非準備預金先                | 676,800            |                   |                   | 1日平均           | 0         |     |
| 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                 | 99.99%            | 日数                | 51.61%         |           |     |

## ●2022年5月31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~▲0.014%での調達で始まった。月末要因によりオフア、ビッド双方の参加者が一時的に減少した事もあり、昨日に比べ出合い水準はやや低下した。一巡後も同水準の出合いが継続し本日の取引を終えた。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、▲0.095~▲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>

31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、小口案件中心で案件も少なく、閑散とした展開に終始した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2022/5/31 | 無担(速報)  |       |         | 有担(速報) |    |    | 短国      | 東京<br>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 | ▲ 0.026 |        |    |    | -       | ▲ 0.096     | 0.235     | 0.005     | 27,279.80 | ▲ 89.63   | 127.78-79 | 127.75-76 |     |
| T/N       |         |       | ▲ 0.013 |        |    |    | -       | ▲ 0.092     |           |           |           |           |           |           |     |
| S/N       |         |       |         |        |    |    | -       | -           |           |           |           |           |           |           |     |
| 1W        |         |       |         |        |    |    | -       | ▲ 0.100     |           |           |           |           |           |           |     |
| 2W        |         |       | ▲ 0.020 |        |    |    | -       | ▲ 0.104     |           |           |           |           |           |           |     |
| 3W        |         |       |         |        |    |    | -       | ▲ 0.111     |           |           |           |           |           |           |     |
| 1M        |         |       |         |        |    |    | -       | ▲ 0.117     |           |           |           |           |           |           |     |
| 3M        |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.099 | ▲ 0.115     |           |           |           |           |           |           |     |
| 6M        |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.105 | ▲ 0.112     |           |           |           |           |           |           |     |
| 1Y        |         |       |         |        |    |    | ▲ 0.105 | ▲ 0.111     |           |           |           |           |           |           |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | 日付        | 5/24      | 5/25      | 5/26      | 5/27      | 5/30      |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | 日銀当預残     | 5,532,700 | 5,539,800 | 5,567,300 | 5,500,000 | 5,477,100 |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | 準備預金残     | 4,851,000 | 4,857,700 | 4,890,300 | 4,821,800 | 4,801,500 |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | マネタリーベース  | 6,778,900 | 6,785,900 | 6,814,500 | 6,747,300 | 6,723,900 |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | 無担O/N加重平均 | ▲0.020%   | ▲0.020%   | ▲0.019%   | ▲0.021%   | ▲0.022%   |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | コール市場残高   | 218,276   | 214,706   | 221,434   | 239,417   | 220,542   |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | うち無担      | 188,198   | 184,397   | 191,276   | 208,619   | 189,356   |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | うちO/N     | 100,245   | 91,879    | 97,858    | 116,926   | 99,063    |     |
|           |         |       |         |        |    |    |         |             | うち有担      | 30,078    | 30,309    | 30,158    | 30,798    | 31,186    |     |

## ●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・利回較差 | 棄分率      | 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) |
|--------|-----|--------|--------|----------|----------|-----------|----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 2年利付国債 | 437 | 0.005% | 28,000 | 2022/6/1 | 2024/6/1 | 122,827.0 | 22,637.0 | 100.1200 | ▲0.0540%    | 32.8287% | 100.1270 | ▲0.0580%    | 5,352.0       |

## ●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 |
|------------------------------|---------------|-----------|----------|---------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 国庫短期証買入                      | 5,000         | 2022/6/1  |          |         | 19,986        | 5,006         | 0.007           |                 | 0.009             | 10.9 |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)     |               | 2022/5/31 | 2022/6/1 | ▲ 0.350 | 2,116         | 2,116         |                 | ▲0.350          | ▲0.350            |      |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)     |               | 2022/5/31 | 2022/6/1 | ▲ 0.350 | 0             | 0             |                 |                 |                   |      |
| 米ドル資金供給                      |               | 2022/6/2  | 2022/6/9 | 1.080   | 0             | 0             |                 |                 |                   |      |
| 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※ |               | 2022/6/1  |          |         | 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。

## ●2022年6月1日の予定

|                   |                 |
|-------------------|-----------------|
| *1-3月期の法人企業統計調査季報 | *米ページブック        |
|                   | *4月の米建設支出       |
|                   | *5月のISM 製造業景況指数 |

◆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り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