

Central Daily Market Report

2022年5月2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2日 需給速報		2022年5月6日 需給予想		2022年5月9日 当社予想	
銀行券	200		2,100		3,000	
財政	▲ 24,400		▲ 22,700		▲ 45,000	
資金過不足	▲ 24,200		▲ 20,600		▲ 42,000	
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	5,800					
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
新型コロナウイルス対応 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 9,300	5,800		9,300		
当預増減	▲ 22,000		▲ 11,400		▲ 42,000	
当座預金残高	5,599,800		5,588,400		5,546,400	
準備預金残高	4,917,800					
積み終了先	4,917,800		5月6日以降の残り所要積立額		積数 100	
超過準備	4,917,700		積数		1日平均 0	
非準備預金先	682,000					
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,709,200	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	66.67%		

●2022年5月2日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.028~▲0.008%の調達で始まった。連休の谷間であったが市場参加者に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。ターム物はショートタームの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.10%程度での出会い。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>

2日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、入札件数が僅かで閑散としていた。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●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。

●短期金融市場関連指標

2022/5/2	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.109	0.225	0.010	26,818.53	▲ 29.37	129.99-01	130.10-12
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.133						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	0.005	▲ 0.025				-	▲ 0.133						
2W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.130						
3W							-	▲ 0.132						
1M	▲ 0.020	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.127						
3M							▲ 0.151	▲ 0.123						
6M							▲ 0.110	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.111						
									日付	4/22	4/25	4/26	4/27	4/28
									日銀当預残	5,657,600	5,643,800	5,648,300	5,677,800	5,621,800
									準備預金残	4,980,900	4,957,700	4,959,300	4,975,400	4,922,800
									マネタリーベース	6,909,300	6,897,500	6,904,900	6,937,500	6,884,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.015%	▲ 0.016%	▲ 0.017%	▲ 0.018%	▲ 0.021%
									コール市場残高	200,737	199,654	194,564	204,748	198,784
									うち無担	169,210	167,922	172,327	182,035	179,140
									うちO/N	95,062	83,834	88,369	106,382	108,002
									うち有担	31,527	31,732	22,237	22,713	19,644

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/2	2022/5/6	▲ 0.350	9,207	9,207		▲ 0.350	▲ 0.378	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/2	2022/5/6	▲ 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)※		2022/5/6			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365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3日の予定

*憲法記念日
*米FOMC(1日目)
*3月の米製造業新規受注・出荷・在庫

●2022年5月4日の予定

*みどりの日
*米FOMC(2日目)
*3月の米貿易収支
*4月のISM 非製造業景況指数

●2022年5月5日の予定

*こどもの日
*英中銀MPC結果発表

●2022年5月6日の予定

*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
*4月の都区部消費者物価指数(CPI)
市場予想:前年同期比(除く生鮮)+1.8%
*4月のマネタリーベース

*3月の米消費者信用残高
*4月の米雇用統計

*国庫短期証券(1077回)入札
(3ヶ月、59,000億円、5/9発行)
*流動性供給入札
(5,000億円、5/9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