

# Central Daily Market Report

2022年5月10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10日 需給速報	2022年5月11日 需給予想	2022年5月12日 当社予想				
銀行券	2,500	2,500	2,000				
財政	3,500	▲ 18,600	▲ 6,000				
資金過不足	6,000	▲ 16,100	▲ 4,000				
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			5,100	▲ 4,500			
国債買現							
国債売現							
国庫短期証買入							
国債買入	12,300						
CP等買入		▲ 300		▲ 500			
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	▲ 12,000	10,700		12,000			
米ドル資金供給用担保提供増額							
当預増減	16,700	▲ 4,000		▲ 4,000			
当座預金残高	5,558,000	5,554,000		5,550,000			
準備預金残高	4,884,400						
積み終了先	4,884,400			5月11日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,884,400			積数		0	
非準備預金先	673,600			1日平均		0	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						3,732,400	
準備預金進捗率	実績	100.00%		日数		83.33%	

## ●2022年5月10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▲0.025~▲0.005%の調達で始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで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~▲0.08%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>

10日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は、大型含めて複数の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばいで推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/5/10	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.088	0.245	0.000	26,167.10	▲ 152.24	130.37-39	130.34-37
T/N			▲ 0.008				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.005	▲ 0.012				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.101						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.023	▲ 0.010	▲ 0.017				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.134	▲ 0.117						
6M							▲ 0.102	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.111						
									日付	4/27	4/28	5/2	5/6	5/9
									日銀当預残	5,677,800	5,621,800	5,599,800	5,574,400	5,541,300
									準備預金残	4,975,400	4,922,800	4,917,800	4,890,200	4,871,300
									マネタリーベース	6,937,500	6,884,100	6,861,800	6,834,200	6,799,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.021%	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.017%
									ロール市場残高	204,748	198,784	219,823	217,152	181,162
									うち無担	182,035	179,140	190,582	190,163	149,116
									うちO/N	106,382	108,002	120,154	119,520	79,523
									うち有担	22,713	19,644	29,241	26,989	32,046

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	366	0.200%	27,000	2022/5/11	2032/3/20	125,691.0	21,887.0	99,530.0	0.2480%	25.2561%	99,560.0	0.2450%	5,103.0	2,850.0
交付税特会	-	-	13,000	2022/5/18	2022/11/18	514,353.0	12,990.21		0.0000%	2.5256%		0.0000%		10,000.0

## ●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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2022/5/11	2022/5/25		5,050	5,050				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/10	2022/5/11	▲ 0.350	11,974	11,974		▲ 0.350	▲ 0.364	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/10	2022/5/11	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/5/12	2022/5/19	1.090	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/5/11			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、0.005%。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11日の予定

*3月の景気動向指数速報	*4月の米財政収支
*4月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*4月の米消費者物価指数

◆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