

# Central Daily Market Report

2022年5月11日(水)  
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11日 需給速報		2022年5月12日 需給予想		2022年5月13日 当社予想	
銀行券	2,500		1,300		1,000	
財政	▲ 22,100		▲ 6,400		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 19,600		▲ 5,100		▲ 6,000	
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			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 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						
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						
国債補完供給	▲ 2,600	12,000		2,600		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 10,100		2,300		▲ 6,000	
当座預金残高	5,547,900		5,550,200		5,544,200	
準備預金残高	4,876,900					
積み終了先	4,876,900		5月12日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	4,876,900				1日平均	
非準備預金先	671,000				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	86.67%		

## ●2022年5月11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▲0.015~▲0.003%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合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、▲0.110~▲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>

11日は短国買入オペが前回と同額の5000億円でオファーされ、甘めな結果となった。マーケットでは1Y物に出合いが見られた。

### <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

2022/5/11	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	▲ 0.045	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.094	0.245	0.000	26,213.64	46.54	130.36-38	129.96-98
T/N			▲ 0.008				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.013	0.170	0.012				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.108						
1M	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.115						
3M							▲ 0.130	▲ 0.118						
6M							▲ 0.102	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.111						
									日付	4/28	5/2	5/6	5/9	5/10
									日銀当預残	5,621,800	5,599,800	5,574,400	5,541,300	5,558,000
									準備預金残	4,922,800	4,917,800	4,890,200	4,871,300	4,884,400
									マネタリーベース	6,884,100	6,861,800	6,834,200	6,799,100	6,813,300
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.020%	▲0.019%	▲0.017%	▲0.013%
									コール市場残高	198,784	219,823	217,152	181,162	182,180
									うち無担	179,140	190,582	190,163	149,116	151,270
									うちO/N	108,002	120,154	119,520	79,523	81,267
									うち有担	19,644	29,241	26,989	32,046	30,910

## ●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	募入最高利回	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	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
国庫短期証券買入	5,000	2022/5/12			15,666	5,001	0.011		0.011	85.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/11	2022/5/12	▲ 0.350	2,577	2,577		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/11	2022/5/12	▲ 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)※		2022/5/12			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12日の予定

*決定会合における主な意見(4月27・28日分)	*4月の米生産者物価指数	*30年利付国債入札(9,000億円、5/13発行)
*3月の国際収支	*1-3月期の英GDP速報値	*エネルギー対策借入(8,000億円、5/20借入)
*4月の景気ウォッチャー調査		

◆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