

Central Daily Market Report

2022年5月13日(金)

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13日 需給速報	2022年5月16日 需給予想	2022年5月17日 当社予想
銀行券	1,900	1,400	1,000
財政	▲ 8,200	▲ 12,300	4,000
資金過不足	▲ 6,300	▲ 10,900	5,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		14,600	
CP等買入	▲ 500	▲ 900	4,000
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 100
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			
国債補完供給	▲ 4,000	4,100	4,000
*ドル資金供給用担保提供増減			
当預増減	▲ 6,700	6,800	8,900
当座預金残高	5,541,100	5,547,900	5,556,800
準備預金残高	4,881,200		
積み終了先	4,881,200		5月16日以降の残り所要積立額
超過準備	4,881,200		積数 3,873,000
非準備預金先	659,900		1日平均 124,900
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	0.00%	日数
			0.00%

●2022年5月13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▲0.01~▲0.002%の調達で始まった。積み最終日にあたることから、引き続き堅調な地合いとなった。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、▲0.10~▲0.085%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>

13日はTB3M物(第1079回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、入札案件が乏しく閑散であった。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/5/13	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	▲ 0.045	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.089	0.240	▲ 0.004	26,427.65	678.93	128.59-60	128.80-81
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.019	▲ 0.010	▲ 0.015				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.028	▲ 0.008	▲ 0.017				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.111						
1M	▲ 0.013	▲ 0.008	▲ 0.011				-	▲ 0.115						
3M			0.005				▲ 0.127	▲ 0.119						
6M							▲ 0.105	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.111						
									日付	5/6	5/9	5/10	5/11	5/12
									日銀当預残	5,574,400	5,541,300	5,558,000	5,547,900	5,547,800
									準備預金残	4,890,200	4,871,300	4,884,400	4,876,900	4,872,800
									マネタリーベース	6,834,200	6,799,100	6,813,300	6,800,700	6,799,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.017%	▲ 0.013%	▲ 0.009%	▲ 0.007%
									コール市場残高	217,152	181,162	182,180	167,912	171,911
									うち無担	190,163	149,116	151,270	138,069	141,164
									うちO/N	119,520	79,523	81,267	70,496	73,341
									うち有担	26,989	32,046	30,910	29,843	30,747

●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・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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1079	-	59,000	2022/5/16	2022/8/15	154,156.0	47,714.0	100.0285	▲0.1142%	62.4000%	100.0304	▲0.1218%	11,286.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/5/16			12,138	4,757	▲0.004		▲0.003	37.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/5/16			9,690	4,751	▲0.008		▲0.007	100.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/5/16			16,292	5,014	▲0.008		▲0.007	18.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/13	2022/5/16	▲ 0.350	3,962	3,962		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/13	2022/5/16	▲ 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)※		2022/5/16			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、0.006%。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16日の予定

*4月の企業物価指数	*10年物価連動国債 (2,000億円、5/17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