Central Daily Market Report

2022年5月16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16日 需給速報		2022年5月17日 需給予想		2022年5月18日 当社予想	
銀行券	1,400		1,100		1,000	
財政	▲ 10,900		▲ 1,900		1,000	
資金過不足	▲ 9,500		▲ 800		2,000	
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	14,600					
CP等買入		▲ 900	4,000	▲ 300		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援				▲ 100		
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 6,100	4,000		6,100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	2,100		8,900		2,000	

当座預金残高	5,543,200	5,552,100	5,554,100
準備預金残高	4,862,200		
積み終了先	3,521,500	5月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,377,200	積数	388,000
非準備預金先	681,000	1日平均	12,900
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 89.98%	日数	3.23%

●2022年5月16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▲0.038～▲0.005%の調達で始まった。新しい積み期間に入ったことから様子見姿勢の先が多く、前営業日より低い水準での取引が中心となった。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、▲0.11～▲0.095%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>

16日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物と3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、複数の業態から入札が実施され、一部でまとまったロットの発行も見られた。発行レートに目立った変化はなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/5/16	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.019				－	▲ 0.098
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.102
S/N							－	－
1W	▲ 0.033	▲ 0.013	▲ 0.026				－	▲ 0.106
2W	▲ 0.028	▲ 0.010	▲ 0.023				－	▲ 0.109
3W							－	▲ 0.113
1M	▲ 0.020	0.001	▲ 0.016				－	▲ 0.118
3M							▲ 0.130	▲ 0.120
6M							▲ 0.105	▲ 0.113
1Y							▲ 0.095	▲ 0.111

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.240	0.000	26,547.05	119.40	129.40-41	129.35-37

日付	5/9	5/10	5/11	5/12	5/13
日銀当預残	5,541,300	5,558,000	5,547,900	5,547,800	5,541,100
準備預金残	4,871,300	4,884,400	4,876,900	4,872,800	4,881,200
マネタリーベース	6,799,100	6,813,300	6,800,700	6,799,200	6,790,600
無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.013%	▲0.009%	▲0.007%	▲0.005%
コール市場残高	181,162	182,180	167,912	171,911	160,122
うち無担	149,116	151,270	138,069	141,164	130,047
うちO/N	79,523	81,267	70,496	73,341	63,234
うち有担	32,046	30,910	29,843	30,747	30,075

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
物価連動10年	27	0.005%	2,000	2022/5/17	2032/3/10	7,229.0	1,998.00	107.6000	▲0.7150%	53.6842%			

●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）		2022/5/16	2022/5/17	▲ 0.350	6,036	6,036		▲0.350	▲0.353	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/5/16	2022/5/17	▲ 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）※		2022/5/17			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、0.010%。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17日の予定

*3月のマネタリーサーベイ
*3月の第3次産業活動指数
*3月の米企業在庫
*4月の米小売売上高
*4月の米鉱工業生産・設備稼働率
*1-3月期のユーロ圏GDP2次速報
*国有林野借入
（631億円、5/25借入）

◆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しする書面や目論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