

Central Daily Market Report

2022年5月17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17日 需給速報	2022年5月18日 需給予想	2022年5月19日 当社予想
銀行券	1,100	300	0
財政	▲ 4,300	▲ 1,300	▲ 26,000
資金過不足	▲ 3,200	▲ 1,000	▲ 26,000
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		5,000	
国債買入			
CP等買入	4,000	▲ 300	▲ 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			
新型コロナウイルス対応金融支援特別			
気候変動対応オペ			
ETF買入			
国債補完供給	▲ 5,700	6,100	5,700
※ドル資金供給用国債国庫券供給			
当増増減	800	9,400	▲ 26,000
当座預金残高	5,544,000	5,553,400	5,527,400
準備預金残高	4,863,700		
積み終了先	4,848,000		5月18日以降の残り所要積立額
超過準備	4,503,100		積数
非準備預金先	680,300		1日平均
			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	99.29%	日数
			6.45%

●2022年5月17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▲0.037~▲0.005%の調達で始まった。前日から大きな変化は見られず、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散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.105%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>

17日は短国買入オペが前回と同額の5,000億円でオファーされ、やや甘めの結果となった。マーケットで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発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/5/17 単位：%	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.104	0.240	0.000	26,659.75	112.70	128.92-94	129.39-41
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.146						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.012				-	▲ 0.131						
2W	▲ 0.020	▲ 0.003	▲ 0.015				-	▲ 0.127						
3W							-	▲ 0.126						
1M	▲ 0.035	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.130	▲ 0.121						
6M							▲ 0.100	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.080	▲ 0.112						
									日付	5/10	5/11	5/12	5/13	5/16
									日銀当預残	5,558,000	5,547,900	5,547,800	5,541,100	5,543,200
									準備預金残	4,884,400	4,876,900	4,872,800	4,881,200	4,862,200
									マネタリーベース	6,813,300	6,800,700	6,799,200	6,790,600	6,791,300
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.009%	▲0.007%	▲0.005%	▲0.019%
									コール市場残高	182,180	167,912	171,911	160,122	198,441
									うち無担	151,270	138,069	141,164	130,047	168,687
									うちO/N	81,267	70,496	73,341	63,234	97,899
									うち有担	30,910	29,843	30,747	30,075	29,754

●入札結果

名称	回号	表額 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 選定額	募入最高利回・利回較差	募入 率	募入 平均価格	募入平均利回・利回較差	第1身割 競争入札(億円)
国有林野借入	-	-	631	2022/5/25	2027/5/25	3,787.0	631.0	-	0.0000%	25.0000%	-	0.0000%	-

●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	2022/5/18			21,006	5,000		0.005	0.007	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/5/18			0	0				
米ドル資金供給		2022/5/19	2022/5/26	1.080	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/17	2022/5/18	▲ 0.350	5,718	5,718		▲ 0.350	▲ 0.370	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/17	2022/5/18	▲ 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)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18日の予定

*1-3月期のGDP 1次速報 (市場予想:前期比年率▲1.8%)	*4月の米住宅着工件数 *4月のユーロ圏消費者物価指数改定値 *4月の英消費者物価指数	*5年利付国債 (25,000億円、5/19発行)
--------------------------------------	---	------------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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の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