

Central Daily Market Report

2022年5月18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18日 需給速報	2022年5月19日 需給予想	2022年5月20日 当社予想
銀行券	400	▲ 100	0
財政	▲ 1,200	▲ 23,300	▲ 2,000
資金過不足	▲ 800	▲ 23,400	▲ 2,000
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		▲ 300	▲ 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			
国債補充供給	▲ 6,100	5,700	6,100
※ドコモ証券供給用国債国債供給			
当増減	3,500	▲ 17,500	▲ 2,000
当座預金残高	5,547,500	5,530,000	5,528,000
準備預金残高	4,861,300		
積み終了先	4,854,200	5月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,850,400	積数 16,400	
非準備預金先	686,200	1日平均 600	
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	99.58%	日数 9.68%

●2022年5月18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。各業態の調達姿勢にあまり変化は見られず、出合い水準は前日とほぼ横ばいとなった。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、▲0.12~▲0.10%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>

18日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物に出合いが見られた。

<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

2022/5/18 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	▲ 0.019				-	▲ 0.098	0.240	0.000	26,911.20	251.45	129.42-44	129.32-34	
T/N	▲ 0.015	▲ 0.011	▲ 0.014				-	▲ 0.119							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.121							
2W	▲ 0.034	0.100	▲ 0.019				-	▲ 0.122							
3W							-	▲ 0.122							
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.124							
3M							▲ 0.130	▲ 0.123							
6M							▲ 0.095	▲ 0.114							
1Y							▲ 0.080	▲ 0.112							
									日付		5/11	5/12	5/13	5/16	5/17
									日銀当預残	5,547,900	5,547,800	5,541,100	5,543,200	5,544,000	
									準備預金残	4,876,900	4,872,800	4,881,200	4,862,200	4,863,700	
									マネタリーベース	6,800,700	6,799,200	6,790,600	6,791,300	6,790,900	
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.007%	▲0.005%	▲0.019%	▲0.018%	
									コール市場残高	167,912	171,911	160,122	198,441	206,362	
									うち無担	138,069	141,164	130,047	168,687	176,040	
									うちO/N	70,496	73,341	63,234	97,899	98,792	
									うち有担	29,843	30,747	30,075	29,754	30,322	

●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非償 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
5年利付国債	151	0.005%	25,000	2022/5/19	2027/3/20	68,738.0	20,203.00	99.9300	0.0190%	96.3432%	99.9400	0.0170%	4,784.0	5.00

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/18	2022/5/19	▲ 0.350	6,089	6,089		▲ 0.350	▲ 0.358	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/18	2022/5/19	▲ 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)※		2022/5/19			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19日の予定

*3月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+3.7%)	*4月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1080回) (1年、35,000億円、5/20発行)
*4月の貿易統計		*交付税特別会計借入
*3月の石油等消費動態統計		(13,000億円、5/31借入)

◆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り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