

Central Daily Market Report

2022年5月6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6日 需給速報	2022年5月9日 需給予想	2022年5月10日 当社予想
銀行券	2,200	1,900	3,000
財政	▲ 26,000	▲ 40,100	3,000
資金過不足	▲ 23,800	▲ 38,200	6,000
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			
CP等買入	▲ 100	▲ 400	
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		200	
国債補完供給	▲ 10,800	9,300	10,800
※ドル資金供給用担保提供特給			
当預増減	▲ 25,400	▲ 27,600	6,000
当座預金残高	5,574,400	5,546,800	5,552,800
準備預金残高	4,890,300		
積み終了先	4,890,300		5月9日以降の残り所要積立額
超過準備	4,890,300		積数
非準備預金先	684,100		1日平均
			0
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額			3,709,200
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			76.67%

●2022年5月6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▲0.028~▲0.008%の調達で始まった。特段大きな変化は見られず、前営業日比で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見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.12~▲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>

6日はTB3M物(第1077回)の入札が実施され、テールが流れるやや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、しっかり推移した。

<CP市場>

CP市場は、入札が少なく閑散としていた。発行レートの目線に変更はなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/5/6	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.107	0.240	0.015	27,003.56	185.03	130.32-35	130.51-53
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.115						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.024				-	▲ 0.122						
2W	▲ 0.020	▲ 0.012	▲ 0.017				-	▲ 0.122						
3W			0.170				-	▲ 0.127						
1M			0.150				-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.137	▲ 0.125						
6M							▲ 0.110	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.112						
									日付	4/25	4/26	4/27	4/28	5/2
									日銀当預残	5,643,800	5,648,300	5,677,800	5,621,800	5,599,800
									準備預金残	4,957,700	4,959,300	4,975,400	4,922,800	4,917,800
									マネタリーベース	6,897,500	6,904,900	6,937,500	6,884,100	6,861,800
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.017%	▲0.018%	▲0.021%	▲0.020%
									コール市場残高	199,654	194,564	204,748	198,784	219,823
									うち無担	167,922	172,327	182,035	179,140	190,582
									うちO/N	83,834	88,369	106,382	108,002	120,154
									うち有担	31,732	22,237	22,713	19,644	29,241

●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	1077	-	59,000	2022/5/9	2022/8/8	119,306.5	47,714.5	100.0290	▲0.1162%	92.9294%	100.0335	▲0.1343%	11,285.0
流動性供給	357	-	5,000	2022/5/9	-	22,034.0	4,987.0	-	0.0070%	39.1222%	-	0.0050%	-

●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)		2022/5/6	2022/5/9	▲ 0.350	10,644	10,644		▲ 0.350	▲ 0.385	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/6	2022/5/9	▲ 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)※		2022/5/9			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、0.020%。この結果、10年利付国債365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9日の予定

*5月の日銀当座預金増減要因見込み	*3月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1078回)入札 (6ヶ月、32,000億円、5/10発行)
*金融政策決定会合議事要旨 (3月17、18日分)		
*3月の毎月勤労統計調査速報		

◆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