

Central Daily Market Report

2022年5月9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9日 需給速報	2022年5月10日 需給予想	2022年5月11日 当社予想			
銀行券	2,100	2,400	3,000			
財政	▲ 35,100	3,600	▲ 19,000			
資金過不足	▲ 33,000	6,000	▲ 16,000			
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						▲ 4,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		12,300				
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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	▲ 10,700	10,800		10,700		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 33,100	28,700		▲ 20,500		
当座預金残高	5,541,300	5,570,000		5,549,500		
準備預金残高	4,871,300					
積み終了先	4,871,200			5月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,871,200			積数		0
非準備預金先	670,000			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		80.00%

●2022年5月9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▲0.035~▲0.008%の調達で始まった。先週から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散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%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>

9日はTB6M物(第1078回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。

<CP市場>

CP市場は、引き続き入札が少なく閑散であった。また、発行レートの目線は横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/5/9	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.087	0.245	0.005	26,319.34	▲ 684.22	130.72-74	131.20-21
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.031				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.024	▲ 0.008	▲ 0.021				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.134	▲ 0.119						
6M							▲ 0.100	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.111						
									日付	4/26	4/27	4/28	5/2	5/6
									日銀当預残	5,648,300	5,677,800	5,621,800	5,599,800	5,574,400
									準備預金残	4,959,300	4,975,400	4,922,800	4,917,800	4,890,200
									マネタリーベース	6,904,900	6,937,500	6,884,100	6,861,800	6,834,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.018%	▲ 0.021%	▲ 0.020%	▲ 0.019%
									コール市場残高	194,564	204,748	198,784	219,823	217,152
									うち無担	172,327	182,035	179,140	190,582	190,163
									うちO/N	88,369	106,382	108,002	120,154	119,520
									うち有担	22,237	22,713	19,644	29,241	26,989

●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	1078	-	32,000	2022/5/10	2022/11/10	92,700.0	25,883.40	100.0460	▲0.0912%	10.7555%	100.0540	▲0.1070%	6,116.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/9	2022/5/10	▲ 0.350	10,558	10,558		▲ 0.350	▲ 0.369	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/9	2022/5/10	▲ 0.350	76	76		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/5/10			0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2022/5/10			5,736	1,501	0.004		0.005	9.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/5/10			8,208	4,752	▲ 0.002		0.001	3.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/5/10			8,787	4,752	▲ 0.002		0.000	63.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/5/10			4,048	1,257	0.011		0.012	19.8

※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10日の予定

*3月の全世帯家計調査 市場予想：消費支出、前年比▲2.8%	*10年利付国債入札 (27,000億円、5/11発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、5/18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