

Central Daily Market Report

2022年5月12日(木)

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12日 需給速報	2022年5月13日 需給予想	2022年5月16日 当社予想			
銀行券	1,400	1,800	2,000			
財政	▲ 4,800	▲ 8,500	▲ 16,000			
資金過不足	▲ 3,400	▲ 6,700	▲ 14,000			
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	5,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 500		
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感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 4,100	2,600		4,100		
当預増減	▲ 100	▲ 3,100		▲ 14,000		
当座預金残高	5,547,800	5,544,700		5,530,700		
準備預金残高	4,872,800					
積み終了先	4,872,800			5月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,872,700			積数	0	
非準備預金先	675,000			1日平均	0	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,732,400	
準備預金進捗率	実績	100.00%		日数	90.00%	

●2022年5月12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▲0.01~▲0.002%の調達で始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。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、▲0.10~▲0.08%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＞

12日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞

CP市場は、大型を含めて複数の入札が実施された。発行レートは、銘柄による強弱がありながらも概ね横ばい圏であった。CP等買入オペは、応札8,178億円、落札3,979億円、按分レート▲0.003%、平均落札レート▲0.002%となり、前回比では按分レートは僅かに上昇、平均レートは僅かに低下した。

●短期金融市場関連指標

2022/5/12	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.045	0.001	▲ 0.007					-	▲ 0.092	0.244	▲ 0.001	25,748.72	▲ 464.92	129.84-86	128.83-85
T/N								-	▲ 0.098						
S/N								-	-						
1W	0.000	0.280	0.163					-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.014					-	▲ 0.108						
3W								-	▲ 0.110						
1M	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.019					-	▲ 0.115						
3M								▲ 0.130	▲ 0.117						
6M								▲ 0.095	▲ 0.113						
1Y								▲ 0.090	▲ 0.111						
日付		5/2	5/6	5/9	5/10	5/11									
日銀当預残		5,599,800	5,574,400	5,541,300	5,558,000	5,547,900									
準備預金残		4,917,800	4,890,200	4,871,300	4,884,400	4,876,900									
マネタリーベース		6,861,800	6,834,200	6,799,100	6,813,300	6,800,700									
無担O/N加重平均		▲0.020%	▲0.019%	▲0.017%	▲0.013%	▲0.009%									
コール市場残高		219,823	217,152	181,162	182,180	167,912									
うち無担		190,582	190,163	149,116	151,270	138,069									
うちO/N		120,154	119,520	79,523	81,267	70,496									
うち有担		29,241	26,989	32,046	30,910	29,843									

●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)
30年利付国債	74	1.00%	9,000	2022/5/13	2052/3/20	22,275.0	7,234.0	99.4000	1.0260%	97.1524%	99.6400	1.0150%	1,758.0
エネルギー対策	-	-	8,000	2022/5/20	2023/5/22	198,337.0	7,999.86	-	0.0000%	4.2031%	-	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/5/12	2022/5/13	▲ 0.350	4,037	4,037		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/5/12	2022/5/13	▲ 0.350	55	55		▲ 0.350	▲ 0.355	
CP等買入	4,000	2022/5/17			8,178	3,979	▲ 0.003		▲ 0.002	13.3
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/5/13			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、0.005%。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13日の予定

*4月のマネーストック	*5月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(1079回)
*3月の特定サービス産業動態統計速報		(3ヶ月、59,000億円、5/16発行)

◆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