

Central Daily Market Report

2022年4月1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4月1日 需給速報	2022年4月4日 需給予想	2022年4月5日 当社予想
銀行券	▲ 300	700	1,000
財政	▲ 34,200	▲ 22,000	1,000
資金過不足	▲ 34,500	▲ 21,300	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			
国債買入			
CP等買入			
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	600		
国債補完供給	▲ 600	9,200	600
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 25,300	▲ 20,700	2,000
当座預金残高	5,606,500	5,585,800	5,587,800
準備預金残高	4,961,100		
積み終了先	4,961,100	4月4日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,961,100	積数	100
非準備預金先	645,400	1日平均	0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,775,500
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			61.29%

●2022年4月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.01~▲0.001%の調達で始まった。期末要因が剥落したことで、調達を再開する動きが見られ、レートは大幅に上昇した。一巡後も同水準で推移し、本日の取引を終えた。ターム物は、新年度に入ったことで、ショートタームの出会いが複数見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲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>

1日はTB3M物(第1070回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、堅調に推移した。この他、1Y物に出会いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、数件の入札が実施された。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

2022/4/1	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.105	0.215	0.005	27,665.98	▲ 155.45	121.74-75	122.63-64
T/N							-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	0.280	0.016				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.102						
3W	▲ 0.002	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.005	0.000	▲ 0.003				-	▲ 0.105						
3M			0.200				▲ 0.109	▲ 0.102						
6M							▲ 0.089	▲ 0.103						
1Y							▲ 0.080	▲ 0.108						
									日付	3/25	3/28	3/29	3/30	3/31
									日銀当預残	5,479,100	5,529,500	5,540,300	5,576,500	5,631,800
									準備預金残	4,828,500	4,869,400	4,887,500	4,945,700	5,006,500
									マネタリーベース	6,726,900	6,777,400	6,788,800	6,825,200	6,880,400
									無担O/N加重平均	▲0.004%	▲0.004%	▲0.004%	▲0.004%	▲0.020%
									コール市場残高	233,704	217,333	219,755	222,906	118,300
									うち無担	203,577	187,893	189,313	193,389	104,325
									うちO/N	106,164	90,945	97,325	112,416	65,397
									うち有担	30,127	29,440	30,442	29,517	13,975

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	1070	-	57,000	2022/4/4	2022/7/11	165,347.0	46,204.1	100.0250	▲0.0930%	58.9961%	100.0263	▲0.0979%	10,795.0
交付税特会	-	-	13,000	2022/4/8	2022/10/11	449,700.0	12,990.36		0.0000%	2.8887%		0.0000%	10.0

●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)		2022/4/1	2022/4/4	▲0.350	634	634		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/1	2022/4/4	▲0.350	0	0				

●2022年4月4日の予定

*3月実績/4月見込み財政資金対民間収支 *3月のマネタリーベース	*米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫
--------------------------------------	---------------------

◆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