

# Central Daily Market Report

2022年4月4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4月4日 需給速報		2022年4月5日 需給予想		2022年4月6日 当社予想	
銀行券	700		900		1,000	
財政	▲ 17,600		3,900		▲ 25,000	
資金過不足	▲ 16,900		4,800		▲ 24,000	
<b>金融調節</b>	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						
国債買入			12,500			
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 2,600	600		2,600		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 18,900		19,900		▲ 24,000	
当座預金残高	5,587,600		5,607,500		5,583,500	
準備預金残高	4,935,600					
積み終了先	4,935,600		4月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,935,600		積数		100	
非準備預金先	652,000		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	64.52%		

## ●2022年4月4日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、一部でビッドレートを引き下げる動きが見られたものの、全体的には前営業日とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.012~▲0.001%近辺の水準で調達が見られた。一巡後は、▲0.05~▲0.005%近辺のレンジで出合いが見られた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.090~▲0.085%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>

4日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物と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

2022/4/4	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.087	0.210	▲ 0.005	27,736.47	70.49	122.62-64	122.65-66
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	▲ 0.002	▲ 0.003				-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.024	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.097						
1M	▲ 0.010	▲ 0.002	▲ 0.006				-	▲ 0.101						
3M			0.150				▲ 0.110	▲ 0.102						
6M							▲ 0.087	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.080	▲ 0.110						
									日付	3/28	3/29	3/30	3/31	4/1
									日銀当預残	5,529,500	5,540,300	5,576,500	5,631,800	5,606,500
									準備預金残	4,869,400	4,887,500	4,945,700	5,006,500	4,961,200
									マネタリーベース	6,777,400	6,788,800	6,825,200	6,880,400	6,855,400
									無担O/N加重平均	▲0.004%	▲0.004%	▲0.004%	▲0.020%	▲0.004%
									コール市場残高	217,333	219,755	222,906	118,300	193,491
									うち無担	187,893	189,313	193,389	104,325	164,212
									うちO/N	90,945	97,325	112,416	65,397	83,959
									うち有担	29,440	30,442	29,517	13,975	29,279

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2022/4/5			5,226	1,503	▲0.003		▲0.001	92.8
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/4/5			14,380	4,756	▲0.005		▲0.003	4.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/4/5			12,524	4,752	▲0.006		▲0.004	50.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/4/5			5,830	1,269	0.003		0.004	28.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/4	2022/4/5	▲ 0.350	2,581	2,581		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/4	2022/4/5	▲ 0.350	0	0				

## ●2022年4月5日の予定

*2月の全世帯家計調査 市場予想：消費支出、前年比+2.7%	*米国2月の貿易収支 *米国3月のISM非製造業景況指数	*10年利付国債入札 (27,000億円、4/6発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、4/15借入)
*2月の毎月勤労統計調査速報		
*4月の日銀当座預金増減要因見込み		

◆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