Central Daily Market Report

2022年4月5日（火）
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5日 需給速報		2022年4月6日 需給予想		2022年4月7日 当社予想	
銀行券	800		400		0	
財政	1,200		▲ 23,500		1,000	
資金過不足	2,000		▲ 23,100		1,000	
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			10,000			
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	▲ 300	2,600		300		
米ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	16,800		▲ 12,800		1,000	

当座預金残高	5,604,400	5,591,600	5,592,600
準備預金残高	4,936,900		
積み終了先	4,936,900		
超過準備	4,936,900		
非準備預金先	667,500		

4月6日以降の残り所要積立額	
積数	100
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 67.74%

●2022年4月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前営業日とほぼ横ばいで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▲0.01～▲0.001%近辺の水準で調達が見られた。一巡後も水準にあまり変化は無く、▲0.01～▲0.005%のレンジを中心に推移した。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、▲0.105～▲0.09%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>

5日は短国買入オペが前回から1兆円減額の1兆円でオファーされ、無難な結果となった。マーケットでは3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数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

2022/4/5	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.005				－	▲ 0.100
T/N			▲ 0.003				－	▲ 0.106
S/N			▲ 0.003				－	－
1W	▲ 0.004	▲ 0.001	▲ 0.002				－	▲ 0.103
2W	▲ 0.005	0.100	0.013				－	▲ 0.105
3W							－	▲ 0.105
1M			▲ 0.002				－	▲ 0.107
3M							▲ 0.114	▲ 0.105
6M							▲ 0.087	▲ 0.105
1Y							▲ 0.080	▲ 0.110

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.210	0.000	27,787.98	51.51	122.79-81	122.89-91

日付	3/29	3/30	3/31	4/1	4/4
日銀当預残	5,540,300	5,576,500	5,631,800	5,606,500	5,587,600
準備預金残	4,887,500	4,945,700	5,006,500	4,961,200	4,935,400
マネタリーベース	6,788,800	6,825,200	6,880,400	6,855,400	6,835,700
無担O/N加重平均	▲0.004%	▲0.004%	▲0.020%	▲0.004%	▲0.004%
コール市場残高	219,755	222,906	118,300	193,491	215,499
うち無担	189,313	193,389	104,325	164,212	185,322
うちO/N	97,325	112,416	65,397	83,959	97,834
うち有担	30,442	29,517	13,975	29,279	30,177

●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Ｉ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	366	0.200%	27,000	2022/4/6	2032/3/20	78,600.0	21,769.0	99.9700	0.2030%	80.3585%	99.9900	0.2010%	5,221.0	3.25
交付税特会	－	－	13,000	2022/4/15	2022/10/14	470,086.0	12,990.20		0.0000%	2.7634%		0.0000%		10.00

●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
国庫短期証券買入	10,000	2022/4/6			26,774	10,007	0.000		0.003	39.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/4/5	2022/4/6	▲ 0.350	329	329		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/4/5	2022/4/6	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/4/7	2022/4/14	0.590	0	0				

●2022年4月6日の予定

*特にありません。

◆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。
◆本資料は何ら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論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