

Central Daily Market Report

2022年4月6日(水)

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6日 需給速報		2022年4月7日 需給予想		2022年4月8日 当社予想	
銀行券	400		▲ 300		0	
財政	▲ 24,400		2,200		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 24,000		1,900		▲ 3,000	
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						
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						
国債補完供給	▲ 600	300		600		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 14,300		2,500		▲ 3,000	
当座預金残高	5,590,100		5,592,600		5,589,600	
準備預金残高	4,914,800					
積み終了先	4,914,800		4月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,914,800		積数		100	
非準備預金先	675,300		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	70.97%		

●2022年4月6日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前営業日と概ね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。一巡後も水準に大きな変化は無く、▲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、▲0.110~▲0.095%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>

6日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<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

2022/4/6	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	▲ 0.005				-	▲ 0.098	0.235	0.025	27,350.30	▲ 437.68	123.65-67	123.88-89
T/N			▲ 0.003				-	▲ 0.110						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.109						
2W			▲ 0.002				-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.109						
1M			▲ 0.005				-	▲ 0.111						
3M							▲ 0.114	▲ 0.109						
6M							▲ 0.087	▲ 0.106						
1Y							▲ 0.080	▲ 0.111						
									日付	3/30	3/31	4/1	4/4	4/5
									日銀当預残	5,576,500	5,631,800	5,606,500	5,587,600	5,604,400
									準備預金残	4,945,700	5,006,500	4,961,200	4,935,400	4,936,900
									マネタリーベース	6,825,200	6,880,400	6,855,400	6,835,700	6,851,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.004%	▲ 0.020%	▲ 0.004%	▲ 0.004%	▲ 0.005%
									コール市場残高	222,906	118,300	193,491	215,499	215,742
									うち無担	193,389	104,325	164,212	185,322	185,497
									うちO/N	112,416	65,397	83,959	97,834	100,549
									うち有担	29,517	13,975	29,279	30,177	30,245

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/6	2022/4/7	▲ 0.350	530	530		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/6	2022/4/7	▲ 0.350	0	0				

●2022年4月7日の予定

*熊本県金融経済懇話会において 野口日銀審議委員講演 *2月の景気動向指数速報 *3月のマネタリーベースと 日本銀行の取引	*米国2月の消費者信用残高	*国庫短期証券(1071回)入札 (6ヶ月、34,000億円、4/11発行) *30年利付国債入札 (9,000億円、4/8発行) *エネルギー対策借入 (8,000億円、4/20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