

Central Daily Market Report

2022年4月8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8日 需給速報	2022年4月11日 需給予想	2022年4月12日 当社予想
銀行券	600	800	1,000
財政	▲ 5,800	▲ 7,800	6,000
資金過不足	▲ 5,200	▲ 7,000	7,000
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		14,800	
CP等買入	▲ 100		
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	▲ 1,600	300	1,600
※ドル資金供給用担保提供額			
当預増減	▲ 6,600	9,400	7,000
当座預金残高	5,588,500	5,597,900	5,604,900
準備預金残高	4,924,800		
積み終了先	4,924,800		
超過準備	4,924,800		
非準備預金先	663,700		
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			3,789,900
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			83.87%

●2022年4月8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▲0.015~▲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、▲0.015~▲0.001%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、参加者が限られる中、▲0.100%を大きく下回る水準での出会いも一部見られるなど、強含んで推移する展開となった。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>

8日はTB3M物(第1072回)の入札が実施され、強めの結果となった。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物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。本日CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は平均落札レート▲0.004%、按分レート▲0.008%と前回(平均▲0.010%・按分▲0.013%)比で平均・按分ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2022/4/8	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	▲ 0.006	0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.106	0.225	▲ 0.005	26,985.80	97.23	124.09-11	124.04-05
T/N							-	▲ 0.116						
S/N			▲ 0.001				-	-						
1W	▲ 0.010	0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.116						
2W							-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.115						
1M							-	▲ 0.116						
3M			0.020				▲ 0.129	▲ 0.110						
6M							▲ 0.125	▲ 0.108						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.112						
									日付	4/1	4/4	4/5	4/6	4/7
									日銀当預残	5,606,500	5,587,600	5,604,400	5,590,100	5,595,100
									準備預金残	4,961,200	4,935,400	4,936,900	4,916,000	4,927,700
									マネタリーベース	6,855,400	6,835,700	6,851,700	6,836,900	6,842,200
									無担O/N加重平均	▲0.004%	▲0.004%	▲0.005%	▲0.005%	▲0.006%
									コール市場残高	193,491	215,499	215,742	201,200	213,196
									うち無担	164,212	185,322	185,497	170,449	181,825
									うちO/N	83,959	97,834	100,549	88,761	99,967
									うち有担	29,279	30,177	30,245	30,751	31,371

●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)
国庫短期証券	1072	-	59,000	2022/4/11	2022/7/19	200,670.5	47,821.6	100.0320	▲0.1179%	70.2434%	100.0332	▲0.1223%	11,178.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/4/11			12,475	4,754	▲0.012		▲0.010	82.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/4/11			9,037	4,755	▲0.009		▲0.007	58.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/4/11			9,301	5,005	▲0.003		0.000	19.9
国債買入(変動利付債)	300	2022/4/11			443	300		▲1.400	▲1.423	
CP等買入	4,000	2022/4/13			9,752	3,997	▲0.008		▲0.004	97.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/8	2022/4/11	▲0.350	1,371	1,371		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/8	2022/4/11	▲0.350	68	68		▲0.350	▲0.350	

●2022年4月11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