

Central Daily Market Report

2022年4月12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12日 需給速報	2022年4月13日 需給予想	2022年4月14日 当社予想			
銀行券	100	400	▲ 1,000			
財政	2,200	▲ 30,800	7,000			
資金過不足	2,300	▲ 30,400	6,000			
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			2,300	▲ 5,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入						
CP等買入			4,000	▲ 300		
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	▲ 300	1,500		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	3,500	▲ 24,200				6,000
当座預金残高	5,600,300	5,576,100	5,582,100			
準備預金残高	4,928,500					
積み終了先	4,928,500			4月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,928,500			積数		0
非準備預金先	671,800			1日平均		0
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	90.32%		

●2022年4月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.025~▲0.001%の出会いで始まった。積み最終日に向けた調達サイドの警戒感から、引き続き小幅低下の推移となった。一巡後は▲0.015~▲0.01%近辺の出会いが散見され、本日の取引を終えた。ターム物は月内物の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲0.15%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>

12日は短国買入オペが前回から5,000億円減額の5,000億円でオファーされ、弱めの結果となった。マーケットでは、1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/4/12	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.008					-	▲ 0.200	0.240	0.005	26,334.98	▲ 486.54	125.47-50	125.52-53
T/N								-	▲ 0.202						
S/N			▲ 0.003					-	-						
1W								-	▲ 0.173						
2W	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.008					-	▲ 0.150						
3W								-	▲ 0.138						
1M	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.002					-	▲ 0.133						
3M			0.000					▲ 0.135	▲ 0.116						
6M								▲ 0.131	▲ 0.114						
1Y								▲ 0.125	▲ 0.115						
										日付	4/5	4/6	4/7	4/8	4/11
										日銀当預残	5,604,400	5,590,100	5,595,100	5,588,500	5,596,800
										準備預金残	4,936,900	4,916,000	4,927,700	4,924,600	4,925,300
										マネタリーベース	6,851,700	6,836,900	6,842,200	6,835,000	6,842,500
										無担O/N加重平均	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.008%
										コール市場残高	215,742	201,200	213,196	223,357	189,708
										うち無担	185,497	170,449	181,825	191,111	163,492
										うちO/N	100,549	88,761	99,967	103,873	76,764
										うち有担	30,245	30,751	31,371	32,246	26,216

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	151	0.005%	25,000	2022/4/13	2027/3/20	73,285.0	20,279.0	99,8800	0.0290%	91.6838%	99.8900	0.0270%	4,713.0	
交付税特会	-	-	13,000	2022/4/22	2022/10/24	500,376.0	12,990.11		0.0000%	2.5961%		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
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2022/4/13	2022/4/27		2,301	2,301				
国庫短期証券買入	5,000	2022/4/13			16,269	5,000		0.009	0.009	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/12	2022/4/13	▲ 0.450	336	336		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/12	2022/4/13	▲ 0.450	0	0				
米ドル資金供給		2022/4/14	2022/4/21	0.600	1	1				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2022/4/13	2022/4/22		2	2		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2022年4月13日の予定

*信託大会において黒田総裁講演
*3月の米生産者物価指数
*2月の機械受注統計
*3月の英消費者物価指数
市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.5%
*3月のマネーストック

◆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