

# Central Daily Market Report

2022年4月13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13日 需給速報		2022年4月14日 需給予想		2022年4月15日 当社予想	
銀行券	400		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	▲ 27,400		12,700		61,000	
資金過不足	▲ 27,000		11,500		60,000	
<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	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			10,300			
CP等買入	4,000	▲ 300		▲ 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				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 300	300		300		
当預増減	▲ 21,100		21,800		60,000	
当座預金残高	5,579,200		5,601,000		5,661,000	
準備預金残高	4,917,000					
積み終了先	4,917,000		4月14日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	4,917,000				0	
非準備預金先	662,200				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	
					93.55%	

## ●2022年4月13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。積み最終日に向け調達量を調整する先が多く、引き続きレートは小幅低下の推移となった。一巡後は▲0.015~▲0.01%近辺の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は新積み期間にかかる引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲0.12%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>

13日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <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

2022/4/13	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.186	0.235	▲ 0.005	26,843.49	508.51	125.41-43	126.05-06
T/N							-	▲ 0.185						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W							-	▲ 0.157						
2W	▲ 0.025	▲ 0.008	▲ 0.023				-	▲ 0.146						
3W							-	▲ 0.134						
1M	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.015				-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.135	▲ 0.115						
6M							▲ 0.126	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.114						
									日付	4/6	4/7	4/8	4/11	4/12
									日銀当預残	5,590,100	5,595,100	5,588,500	5,596,800	5,600,300
									準備預金残	4,916,000	4,927,700	4,924,600	4,925,300	4,928,500
									マネタリーベース	6,836,900	6,842,200	6,835,000	6,842,500	6,845,900
									無担O/N加重平均	▲0.005%	▲0.006%	▲0.006%	▲0.008%	▲0.008%
									コール市場残高	201,200	213,196	223,357	189,708	190,885
									うち無担	170,449	181,825	191,111	163,492	165,503
									うちO/N	88,761	99,967	103,873	76,764	84,740
									うち有担	30,751	31,371	32,246	26,216	25,382

## ●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I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)	発札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回敬差・価格敬差	全取レート・利回敬差・価格敬差	平均発札レート・利回敬差・価格敬差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/4/14			15,727	4,750		0.001	0.002	
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/4/14			12,405	5,012	▲0.008		▲0.007	18.1
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/4/14			2,378	503	▲0.018		▲0.017	63.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/13	2022/4/14	▲0.450	331	331		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/13	2022/4/14	▲0.450	1	1		▲0.450	▲0.450	

## ●2022年4月14日の予定

*ECB定例理事会(金融政策発表)	*20年利付国債入札 (12,000億円、4/15発行)
*3月の米小売売上高	
*2月の米企業在庫	
*4月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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