

Central Daily Market Report

2022年4月14日(木)
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14日 需給速報	2022年4月15日 需給予想	2022年4月18日 当社予想			
銀行券	▲ 1,300	▲ 400	1,000			
財政	14,800	58,900	▲ 8,000			
資金過不足	13,500	58,500	▲ 7,000			
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						
国債買入	10,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 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			500			
国債補完供給	▲ 1,200	300	1,200			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	22,600	60,100	▲ 7,000			
当座預金残高	5,601,800	5,661,900	5,654,900			
準備預金残高	4,930,400					
積み終了先	4,930,400			4月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,930,400			積数	0	
非準備預金先	671,400			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	96.77%		

●2022年4月14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%の出合いが始まった。積み最終日を翌日に控え、着地に向けた調達サイドの調整により、引き続きレート水準は低下した。一巡後は▲0.02%近辺の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートターム物の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15%~▲0.11%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>

14日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物と6M物に少額の出合いが見られた。

<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

2022/4/14	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	▲ 0.013				-	▲ 0.148	0.235	0.000	27,172.00	328.51	125.36-37	125.33-34
T/N							-	▲ 0.145						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.020	0.005	▲ 0.010				-	▲ 0.125						
2W	▲ 0.035	▲ 0.025	▲ 0.028				-	▲ 0.120						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.122						
1M	▲ 0.020	0.011	▲ 0.003				-	▲ 0.120						
3M	0.000	0.020	0.006				▲ 0.125	▲ 0.115						
6M							▲ 0.116	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.114						
									日付	4/7	4/8	4/11	4/12	4/13
									日銀当預残	5,595,100	5,588,500	5,596,800	5,600,300	5,579,200
									準備預金残	4,927,700	4,924,600	4,925,300	4,928,500	4,916,700
									マネタリーベース	6,842,200	6,835,000	6,842,500	6,845,900	6,824,400
									無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.006%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.010%
									コール市場残高	213,196	223,357	189,708	190,885	189,038
									うち無担	181,825	191,111	163,492	165,503	164,313
									うちO/N	99,967	103,873	76,764	84,740	85,080
									うち有担	31,371	32,246	26,216	25,382	24,725

●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)
20年利付国債	180	0.80%	12,000	2022/4/15	2042/3/20	30,226.0	9,744.00	101.0000	0.7420%	98.7309%	101.3100	0.7240%	2,252.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/14	2022/4/15	▲ 0.450	895	895		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/14	2022/4/15	▲ 0.450	300	300		▲ 0.450	▲ 0.450	

●2022年4月15日の予定

*EURO、London祝日(Good Friday) *3月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1073回)入札 (3ヶ月、59,000億円、4/18発行)
---	---

◆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