

Central Daily Market Report

2022年4月22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22日 需給速報	2022年4月25日 需給予想	2022年4月26日 当社予想			
銀行券	▲ 1,400	▲ 1,900	▲ 3,000			
財政	8,100	▲ 13,300	9,000			
資金過不足	6,700	▲ 15,200	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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		4,200				
CP等買入		▲ 200	▲ 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		▲ 100	▲ 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						
国債補完供給	▲ 100	200	100			
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	6,500	▲ 11,200	6,000			
当座預金残高	5,657,600	5,646,400	5,652,400			
準備預金残高	4,982,500					
積み終了先	4,982,100			4月25日以降の残り所要積立額	積数	3,400
超過準備	4,982,100			1日平均		200
非準備預金先	675,100					
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						3,709,200
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数			30.00%

●2022年4月22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▲0.015~▲0.005%の調達で始まった。週末3日積み要因により、調達サイドに取り上がる動きが見られ、レート水準は前日比で上昇した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、今週の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.09%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>

22日はTB3M物(第1076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ショートカバーの動きも見られ、強含んで推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、小口の案件が中心だったが、一部業態から大型発行も実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/4/22	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	▲ 0.015				-	▲ 0.091	0.245	0.000	27,105.26	▲ 447.80	128.42-44	128.05-08
T/N							-	▲ 0.094						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.013	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.101						
3W	▲ 0.040	▲ 0.009	▲ 0.028				-	▲ 0.103						
1M			▲ 0.009				-	▲ 0.107						
3M							▲ 0.145	▲ 0.109						
6M							▲ 0.102	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.089	▲ 0.112						
									日付	4/15	4/18	4/19	4/20	4/21
									日銀当預残	5,661,300	5,655,600	5,661,300	5,640,000	5,651,100
									準備預金残	4,987,300	4,974,100	4,976,700	4,957,500	4,970,200
									マネタリーベース	6,908,200	6,902,100	6,908,400	6,888,200	6,901,500
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.019%	▲0.017%	▲0.016%	▲0.016%
									コール市場残高	167,373	175,874	183,604	190,451	202,952
									うち無担	135,837	144,410	152,579	159,689	172,446
									うちO/N	69,924	81,742	80,276	80,156	91,053
									うち有担	31,536	31,464	31,025	30,762	30,506

●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	1076	-	59,000	2022/4/25	2022/8/1	186,177.5	47,821.70	100.0315	▲0.1172%	32.6938%	100.0320	▲0.1191%	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(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/4/25			4,277	4,277				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/22	2022/4/25	▲ 0.350	121	121		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/22	2022/4/25	▲ 0.350	0	0				

※国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.000%。この結果、10年利付国債365回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年4月25日の予定

- *3月の企業向けサービス価格指数
- *2月の景気動向指数改訂状況

◆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