

# Central Daily Market Report

2022年4月25日(月)

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25日 需給速報		2022年4月26日 需給予想		2022年4月27日 当社予想	
銀行券	▲ 2,000		▲ 2,900		▲ 3,000	
財政	▲ 14,700		5,700		6,000	
資金過不足	▲ 16,700		2,800		3,000	
<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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	4,200		7,200			
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						
国債補充供給	▲ 1,100	100		1,100		
※ドル資金供給用担保提供増額						
<b>当増減</b>	▲ 13,800		11,000		700	
当座預金残高	5,643,800		5,654,800		5,655,500	
準備預金残高	4,958,000					
積み終了先	4,957,600		4月26日以降の残り所要積立額		積数 3,000	
超過準備	4,957,600		1日平均		200	
非準備預金先	685,800					
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	99.92%	日数	33.33%		

## ●2022年4月25日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.03~▲0.005%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが継続し、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの出合いが散見される程度であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.14~▲0.10%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>

25日のアウトライツ市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP市場は、月末発行の前倒し入札分を含めて複数の調達を実施された。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4,000億円でオフアされた。結果は平均落札レート▲0.001%、按分落札レート▲0.004%と前回(平均落札レート▲0.004%・按分落札レート▲0.008%)比で平均・按分ともに上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/4/25	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.106	0.245	0.000	26,590.78	▲ 514.48	128.60-62	128.19-21
T/N							-	▲ 0.131						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.128						
2W				0.000			-	▲ 0.127						
3W				▲ 0.008			-	▲ 0.124						
1M				0.100			-	▲ 0.121						
3M							▲ 0.151	▲ 0.117						
6M							▲ 0.105	▲ 0.111						
1Y							▲ 0.089	▲ 0.111						
									日付	4/18	4/19	4/20	4/21	4/22
									日銀当預残	5,655,600	5,661,300	5,640,000	5,651,100	5,657,600
									準備預金残	4,974,100	4,976,700	4,957,500	4,970,200	4,980,900
									マネタリーベース	6,902,100	6,908,400	6,888,200	6,901,500	6,909,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.016%	▲ 0.015%
									コール市場残高	175,874	183,604	190,451	202,952	200,737
									うち無担	144,410	152,579	159,689	172,446	169,210
									うちO/N	81,742	80,276	80,156	91,053	95,062
									うち有担	31,464	31,025	30,762	30,506	31,527

## ●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1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)	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)※		2022/4/26			7,275	7,275				
CP等買入	4,000	2022/4/28			7,211	3,978	▲ 0.004		▲ 0.001	42.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/4/25	2022/4/26	▲ 0.350	1,012	1,012		▲ 0.350	▲ 0.360	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/4/25	2022/4/26	▲ 0.350	119	119		▲ 0.350	▲ 0.350	

※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ア。

## ●2022年4月26日の予定

*3月の完全失業率 市場予想: 2.7%	*3月の米新築一戸建て販売件数	*交付税特別会計借入 (13,000億円、5/13借入)
*3月の有効求人倍率 市場予想: 1.22倍	*2月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
	*3月の米耐久財新規受注	
	*4月の米CB消費者信頼感指数	

◆本資料は信頼できるとさ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