

Central Daily Market Report

2022年4月26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26日 需給速報		2022年4月27日 需給予想		2022年4月28日 当社予想	
銀行券	▲ 2,900		▲ 3,000		▲ 3,500	
財政	3,600		3,700		10,100	
資金過不足	700		700		6,600	
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			4,500	▲ 2,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	7,200		20,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 100	4,000	
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						▲ 58,200
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 4,400	1,100		4,400		
米ドル資金供給用担保債提供						
当預増減	4,500		32,300		▲ 47,600	
当座預金残高	5,648,300		5,680,600		5,633,000	
準備預金残高	4,959,300					
積み終了先	4,958,900		4月27日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,958,900		積数		2,600	
非準備預金先	689,000		1日平均		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		99.93%		日数	
					36.67%	

●2022年4月26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▲0.028~▲0.005%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが散発的に見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.16~▲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>

26日は短国買入オペが前回と同額の5000億円でオファーされ、無難な結果となった。マーケットでは、1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。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

2022/4/26	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.111	0.245	0.000	26,700.11	109.33	127.77-79	127.87-89
T/N							-	▲ 0.159						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.150						
2W	▲ 0.020	0.005	▲ 0.013				-	▲ 0.149						
3W			▲ 0.008				-	▲ 0.144						
1M	▲ 0.040	0.150	▲ 0.007				-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.151	▲ 0.122						
6M							▲ 0.115	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.112						
									日付	4/19	4/20	4/21	4/22	4/25
									日銀当預残	5,661,300	5,640,000	5,651,100	5,657,600	5,643,800
									準備預金残	4,976,700	4,957,500	4,970,200	4,980,900	4,957,700
									マネタリーベース	6,908,400	6,888,200	6,901,500	6,909,300	6,897,500
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.016%	▲0.016%	▲0.015%	▲0.016%
									コール市場残高	183,604	190,451	202,952	200,737	199,654
									うち無担	152,579	159,689	172,446	169,210	167,922
									うちO/N	80,276	80,156	91,053	95,062	83,834
									うち有担	31,025	30,762	30,506	31,527	31,732

●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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
交付税特会			13,000	2022/5/13	2022/11/14	495,449.0	12,990.64		0.0000%	2.6220%		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	実行利率	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・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均発札レート・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	2022/4/27	2022/5/11		4,450	4,450				
国庫短期証券買入	5,000	2022/4/27			16,271	5,002	0.002		0.004	23.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/4/27			8,568	4,756	0.000		0.001	81.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/4/27			13,592	5,009	▲0.003		▲0.002	71.3
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/4/27			2,624	505	▲0.019		▲0.019	44.4
国債買入(物価連動債)	600	2022/4/27			2,781	601	▲0.400		▲0.478	55.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/26	2022/4/27	▲ 0.350	4,442	4,442		▲0.350	▲0.366	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/26	2022/4/27	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/4/28	2022/5/12	0.800	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/4/27			9,215	9,215				

※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27日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合 (1日目、28日まで)	*2年利付国債入札 (28,000億円、5/2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