

Central Daily Market Report

2022年4月27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27日 需給速報	2022年4月28日 需給予想	2022年5月2日 当社予想			
銀行券	▲ 3,100	▲ 2,600	0			
財政	6,500	800	▲ 26,000			
資金過不足	3,400	▲ 1,800	▲ 26,000			
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	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	19,700					
CP等買入		▲ 100	4,000	▲ 1,900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別			2,400	▲ 58,200		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 4,500	3,800		5,100		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	29,500	▲ 50,400	▲ 26,000			
当座預金残高	5,677,800	5,627,400	5,601,400			
準備預金残高	4,975,400					
積み終了先	4,975,000			4月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,975,000			積数	2,200	
非準備預金先	702,400			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	99.94%	日数	40.00%		

●2022年4月27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引き合いがあった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲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>

27日のアウトライト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発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2022/4/27	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.018					-	▲ 0.118	0.245	0.000	26,386.63	▲ 313.48	127.25-27	127.98-00
T/N	▲ 0.013	▲ 0.005	▲ 0.008					-	▲ 0.191						
S/N			▲ 0.003					-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.008	▲ 0.010					-	▲ 0.173						
2W	▲ 0.029	▲ 0.005	▲ 0.022					-	▲ 0.163						
3W								-	▲ 0.154						
1M								-	▲ 0.148						
3M								▲ 0.151	▲ 0.125						
6M								▲ 0.110	▲ 0.114						
1Y								▲ 0.096	▲ 0.111						
日付		4/20	4/21	4/22	4/25	4/26									
日銀当預残		5,640,000	5,651,100	5,657,600	5,643,800	5,648,300									
準備預金残		4,957,500	4,970,200	4,980,900	4,957,700	4,959,300									
マネタリーベース		6,888,200	6,901,500	6,909,300	6,897,500	6,904,900									
無担O/N加重平均		▲0.016%	▲0.016%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.017%									
コール市場残高		190,451	202,952	200,737	199,654	194,564									
うち無担		159,689	172,446	169,210	167,922	172,327									
うちO/N		80,156	91,053	95,062	83,834	88,369									
うち有担		30,762	30,506	31,527	31,732	22,237									

●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)
2年利付国債	436	0.005%	28,000	2022/5/2	2024/5/1	98,021.0	22,584.0	100.1100	▲0.0500%	4.8301%	100.1180	▲0.0540%	5,408.0

●オペ結果

種類	オフー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	店札総額(億円・百万ドル)	残札総額(億円・百万ドル)	積分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均積分レート・利回較差・価格較差	積分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)		2022/4/27	2022/4/28	▲ 0.450	4,444	4,444		▲ 0.450	▲ 0.461	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)		2022/4/27	2022/4/28	▲ 0.450	36	36		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/4/28			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ー。										
種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)					
新型コロナ対応金融支援特別	制度融資分	2022/4/28	2022/10/27	0	1,957					
新型コロナ対応金融支援特別	プロパー融資分	2022/4/28	2022/10/27	0	436					
(参考) 2022/4/28時点の貸出残高(億円)										
制度融資分(2022/4/1以降実行)										1,957
プロパー融資分(2022/4/1以降実行)										436
2022/3/31以前に実行された貸付け										810,134
合計										812,527

*日銀政策委員会・金融政策決定会合 (2日目 終了後直ちに結果公表) *黒田日銀総裁定例会見 *経済・物価情勢の展望	*3月の商業動態統計速報 *3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 市場予想:前月比+0.5% *3月の住宅着工統計	*1-3月期の米GDP速報値
---	--	----------------

◆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