

# Central Daily Market Report

2022年4月28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28日 需給速報	2022年5月2日 需給予想	2022年5月6日 当社予想			
銀行券	▲ 2,600	500	3,000			
財政	1,000	▲ 21,500	▲ 11,000			
資金過不足	▲ 1,600	▲ 21,000	▲ 8,000			
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			5,800			
CP等買入	4,000	▲ 1,900	▲ 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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別	2,400	▲ 58,200				
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 5,800	5,100	5,800			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 56,000	▲ 9,500	▲ 8,000			
当座預金残高	5,621,800	5,612,300	5,604,300			
準備預金残高	4,922,800					
積み終了先	4,922,400			5月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,922,400			積数	600	
非準備預金先	699,000			1日平均	0	
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	99.98%	日数	53.33%		

## ●2022年4月28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▲0.030~▲0.008%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、▲0.18~▲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見られた。

### <短国市場>

28日のアウトライ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、一部で大型発行も見られたが案件は少なかった。発行レートは概ね横ばい圏であった。

## ●入札結果

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。

## ●2022年4月29日の予定

\*3月の米個人所得・消費支出 \*4月のシカゴPM景況感指数  
\*4月のユーロ圏消費者物価指数速報値 \*1-3月期のユーロ圏GDP1次速報

## ●2022年5月2日の予定

\*4月の消費動向調査 \*3月の米建設支出  
\*4月のISM 製造業景況指数

## ●短期金融市場関連指標

2022/4/28	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.128	0.215	▲ 0.030	26,847.90	461.27	128.43-45	130.59-60
T/N	▲ 0.015	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.148						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.144						
2W	▲ 0.035	0.100	▲ 0.028				-	▲ 0.142						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.139						
1M	▲ 0.008	0.000	▲ 0.005				-	▲ 0.140						
3M							▲ 0.151	▲ 0.127						
6M							▲ 0.110	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.111						
日付	4/21	4/22	4/25	4/26	4/27									
日銀当預残	5,651,100	5,657,600	5,643,800	5,648,300	5,677,800									
準備預金残	4,970,200	4,980,900	4,957,700	4,959,300	4,975,400									
マネタリーベース	6,901,500	6,909,300	6,897,500	6,904,900	6,937,500									
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.015%	▲0.016%	▲0.017%	▲0.018%									
コール市場残高	202,952	200,737	199,654	194,564	204,748									
うち無担	172,446	169,210	167,922	172,327	182,035									
うちO/N	91,053	95,062	83,834	88,369	106,382									
うち有担	30,506	31,527	31,732	22,237	22,713									

## ●オペ結果

種類	オフターム (億円/百万円)	スタート日	エンド日	買付 利率	売付総額 (億円/百万円)	買付総額 (億円/百万円)	貸付レート ・有担総額 ・無担総額	全取レート ・有担総額 ・無担総額	平均貸付レート ・有担総額 ・無担総額	貸付比率
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/5/2			5,816	5,816				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/5/2			0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフターム)		2022/4/28	2022/5/2	▲ 0.450	5,811	5,811		▲ 0.450	▲ 0.471	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフターム)		2022/4/28	2022/5/2	▲ 0.450	0	0				

※1国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回り変動率は、0.0000%、この結果、10年利付国債365回の買入総額は、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオフターム。 ※2国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回り変動率は、0.0000%、この結果、10年利付国債365回の買入総額は、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオフターム。

## ●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。

(1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)

①次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。

短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

②連続指値オペの運用の明確化

上記の金融市場調節方針を実現するため、10年物国債金利について0.25%の利回りでの指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施することとした。

(2) 資産買入れ方針(全員一致)

長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。

①ETFおよびJ-REITについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。

②CP等、社債等については、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(CP等: 約2兆円、社債等: 約3兆円)へと徐々に戻していく。

2. 日本銀行は、2%の「物価安定の目標」の実現を目指し、これを安定的に持続するために必要な時点まで、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続する。マネタリーベースについては、消費者物価指数(除く生鮮食品)の前年比上昇率の実績値が安定的に2%を超えるまで、拡大方針を継続する。

当面、新型コロナウイルス感染症の影響を注視し、企業等の資金繰り支援と金融市場の安定維持に努めるとともに、必要があれば、躊躇なく追加的な金融緩和措置を講じる。政策金利については、現在の長短金利の水準、または、それを下回る水準で推移することを想定している。

◆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