

Central Daily Market Report

2022年4月7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7日 需給速報		2022年4月8日 需給予想		2022年4月11日 当社予想	
銀行券	▲ 300		500		2,000	
財政	5,000		▲ 4,100		▲ 8,000	
資金過不足	4,700		▲ 3,600		▲ 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						
CP等買入			▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 300	600	300			
当預増減	5,000		▲ 3,400		▲ 6,000	
当座預金残高	5,595,100		5,591,700		5,585,700	
準備預金残高	4,927,700					
積み終了先	4,927,700		4月8日以降の残り所要積立額		積数 100	
超過準備	4,927,700		積数		100	
非準備預金先	667,400		1日平均		0	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,789,900	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	74.19%		

●2022年4月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前営業日と概ね横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.012~▲0.001%近辺の水準で調達が見られた。一巡後も水準にあまり変化は無く、▲0.01~▲0.001%のレンジを中心に推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.110~▲0.100%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>

7日はTB6M物(第1071回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。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、堅調に推移した。この他、1Y物に出合いが見られた。

<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、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/4/7	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.098	0.230	▲ 0.005	26,888.57	▲ 461.73	123.71-74	123.75-77
T/N			▲ 0.003				-	▲ 0.110						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.008	▲ 0.005	▲ 0.006				-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.110						
1M			0.130				-	▲ 0.110						
3M							▲ 0.114	▲ 0.109						
6M							▲ 0.110	▲ 0.106						
1Y							▲ 0.105	▲ 0.111						
									日付	3/31	4/1	4/4	4/5	4/6
									日銀当預残	5,631,800	5,606,500	5,587,600	5,604,400	5,590,100
									準備預金残	5,006,500	4,961,200	4,935,400	4,936,900	4,916,000
									マネタリーベース	6,880,400	6,855,400	6,835,700	6,851,700	6,836,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.004%	▲ 0.004%	▲ 0.005%	▲ 0.005%
									コール市場残高	118,300	193,491	215,499	215,742	201,200
									うち無担	104,325	164,212	185,322	185,497	170,449
									うちO/N	65,397	83,959	97,834	100,549	88,761
									うち有担	13,975	29,279	30,177	30,245	30,751

●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	1071	-	34,000	2022/4/11	2022/10/11	137,291.0	27,562.7	100.0480	▲0.0956%	34.6509%	100.0490	▲0.0976%	6,437.0
30年利付国債	74	1.00%	9,000	2022/4/8	2052/3/20	22,267.0	7,303.0	100.1500	0.9930%	13.0925%	100.2500	0.9890%	1,690.0
エネルギー対策	-	-	8,000	2022/4/20	2023/4/20	214,832.0	7,999.79		0.0000%	3.7238%		0.0000%	

●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	平均落札レート・利回較差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/7	2022/4/8	▲ 0.350	280	280		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/7	2022/4/8	▲ 0.350	0	0				

●2022年4月8日の予定

*2月の国際収支	*2月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1072回)入札(3ヶ月、59,000億円、4/11発行)
*2月の特定サービス産業動態統計速報		
*3月の消費動向調査		
*3月の景気ウオッチャー調査		

◆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