Central Daily Market Report

2022年4月11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11日 需給速報	2022年4月12日 需給予想	2022年4月13日 当社予想
銀行券	800	100	0
財政	▲ 7,400	2,500	32,000
資金過不足	▲ 6,600	2,600	32,000

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						▲ 5,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	14,800					
CP等買入					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						
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 1,500	1,600		1,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	8,300		4,100		30,900	

当座預金残高	5,596,800	5,600,900	5,631,800
準備預金残高	4,925,700		
積み終了先	4,925,700		
超過準備	4,925,700		
非準備預金先	671,100		

4月12日以降の残り所要積立額	
積数	0
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	87.10%

●2022年4月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.015～▲0.001%の出合いで始まった。積みの終盤にかかり、調達サイドの調整の動きから、前営業日対比で小幅低下の推移となった。一巡後は▲0.015～▲0.01%の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20～▲0.15%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>

11日のアウトライト市場は堅調な展開となる中、3M物、6M物を中心に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、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

2022/4/11	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.008				－	▲ 0.198
T/N							－	▲ 0.200
S/N			▲ 0.003				－	－
1W			▲ 0.003				－	▲ 0.164
2W							－	▲ 0.143
3W							－	▲ 0.138
1M			▲ 0.005				－	▲ 0.128
3M							▲ 0.135	▲ 0.116
6M							▲ 0.131	▲ 0.112
1Y							▲ 0.125	▲ 0.114

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.235	0.010	26,821.52	▲ 164.28	124.39-41	125.24-26

日付	4/4	4/5	4/6	4/7	4/8
日銀当預残	5,587,600	5,604,400	5,590,100	5,595,100	5,588,500
準備預金残	4,935,400	4,936,900	4,916,000	4,927,700	4,924,600
マネタリーベース	6,835,700	6,851,700	6,836,900	6,842,200	6,835,000
無担O/N加重平均	▲0.004%	▲0.005%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.006%
コール市場残高	215,499	215,742	201,200	213,196	223,357
うち無担	185,322	185,497	170,449	181,825	191,111
うちO/N	97,834	100,549	88,761	99,967	103,873
うち有担	30,177	30,245	30,751	31,371	32,246

●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Ｉ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/4/11	2022/4/12	▲ 0.350	1,468	1,468		▲0.350	▲0.356	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/4/11	2022/4/12	▲ 0.350	0	0				

●2022年4月12日の予定

*3月の企業物価指数
*3月の米財政収支
*3月の米消費者物価指数
*5年利付国債入札
（25,000億円、4/13発行）
*交付税特別会計借入
（13,000億円、4/22借入）

◆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論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