

# Central Daily Market Report

2022年4月18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18日 需給速報	2022年4月19日 需給予想	2022年4月20日 当社予想			
銀行券	300	▲ 500	▲ 1,000			
財政	▲ 5,800	4,100	▲ 25,000			
資金過不足	▲ 5,500	3,600	▲ 26,000			
<b>金融調節</b>	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		▲ 200	▲ 100	1,000		
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						
国債補充供給		100				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 5,700	3,500	▲ 25,000			
当座預金残高	5,655,600	5,659,100	5,634,100			
準備預金残高	4,974,100					
積み終了先	4,970,500		4月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,964,400		積数			
非準備預金先	681,500		1日平均			
			300			
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	99.80%	日数	10.00%		

## ●2022年4月18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▲0.03~▲0.005%の調達で始まった。積み初日の取引となり、調達サイドは先週末よりもレート目線を下げたのスタートとなった。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### ＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.12~▲0.09%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＞

18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、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。発行レートは引き続き0%付近での決着が中心となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/4/18	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.088	0.240	0.000	26,799.71	▲ 293.48	126.61-63	126.63-65
T/N							-	▲ 0.091						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.007	▲ 0.017				-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.035	0.100	▲ 0.024				-	▲ 0.098						
3W	▲ 0.035	▲ 0.003	▲ 0.030				-	▲ 0.101						
1M	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.015				-	▲ 0.104						
3M			0.180				▲ 0.105	▲ 0.110						
6M							▲ 0.105	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.080	▲ 0.113						
									日付	4/11	4/12	4/13	4/14	4/15
									日銀当預残	5,596,800	5,600,300	5,579,200	5,601,800	5,661,300
									準備預金残	4,925,300	4,928,500	4,916,700	4,930,400	4,987,300
									マネタリーベース	6,842,500	6,845,900	6,824,400	6,848,300	6,908,200
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.008%	▲0.010%	▲0.013%	▲0.016%
									コール市場残高	189,708	190,885	189,038	197,648	167,373
									うち無担	163,492	165,503	164,313	171,256	135,837
									うちO/N	76,764	84,740	85,080	91,723	69,924
									うち有担	26,216	25,382	24,725	26,392	31,536

## ●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	棄分率	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/18	2022/4/19	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/18	2022/4/19	▲ 0.350	0	0				

## ●2022年4月19日の予定

*3月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1074回)入札 (1年、35,000億円、4/20発行) *流動性供給入札 (5,000億円、4/20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