

Central Daily Market Report

2022年4月19日(火)
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19日 需給速報		2022年4月20日 需給予想		2022年4月21日 当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 1,200		▲ 2,000	
財政	7,000		▲ 16,500		500	
資金過不足	6,400		▲ 17,700		▲ 1,500	
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		▲ 100	1,000	▲ 200		
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	▲ 600			600		
米ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	5,700		▲ 16,400		▲ 1,500	
当座預金残高	5,661,300		5,644,900		5,643,400	
準備預金残高	4,976,700					
積み終了先	4,976,000		4月20日以降の残り所要積立額		積数 6,000	
超過準備	4,975,100		1日平均		200	
非準備預金先	684,600					
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	99.84%	日数	13.33%		

●2022年4月19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▲0.02~▲0.005%の調達で始まった。調達サイドの旺盛なニーズを受け、レート水準は前日比で上昇した。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、▲0.10~▲0.08%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>

19日はTB1Y物(第1074回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/4/19	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	▲ 0.017				-	▲ 0.104	0.242	0.002	26,985.09	185.38	127.14-16	128.06-08
T/N							-	▲ 0.094						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.015	▲ 0.008	▲ 0.012				-	▲ 0.100						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.103						
1M	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.106						
3M							▲ 0.108	▲ 0.110						
6M							▲ 0.094	▲ 0.112						
1Y							▲ 0.075	▲ 0.113						
									日付	4/12	4/13	4/14	4/15	4/18
									日銀当預残	5,600,300	5,579,200	5,601,800	5,661,300	5,655,600
									準備預金残	4,928,500	4,916,700	4,930,400	4,987,300	4,974,100
									マネタリーベース	6,845,900	6,824,400	6,848,300	6,908,200	6,902,100
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.010%	▲0.013%	▲0.016%	▲0.019%
									コール市場残高	190,885	189,038	197,648	167,373	175,874
									うち無担	165,503	164,313	171,256	135,837	144,410
									うちO/N	84,740	85,080	91,723	69,924	81,742
									うち有担	25,382	24,725	26,392	31,536	31,464

●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	1074	-	35,000	2022/4/20	2023/4/20	87,424.0	28,371.8	100.0660	▲0.0659%	1.5135%	100.0790	▲0.0789%	6,628.0
流動性供給	355	-	5,000	2022/4/20		23,184.0	4,985.0		▲0.0080%	58.4130%		▲0.0090%	

●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
米ドル資金供給		2022/4/21	2022/4/28	0.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/19	2022/4/20	▲0.350	565	565		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/19	2022/4/20	▲0.350	0	0				

●2022年4月20日の予定

*3月の貿易統計	*米ページブック *3月の米中古住宅販売
----------	-------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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