Central Daily Market Report

2022年4月21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21日 需給速報	2022年4月22日 需給予想	2022年4月25日 当社予想
銀行券	▲ 2,200	▲ 1,400	▲ 1,000
財政	▲ 4,700	13,600	▲ 19,000
資金過不足	▲ 6,900	12,200	▲ 20,000

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	18,300					
CP等買入				▲ 200		
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		▲ 100		
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	▲ 200			200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	11,100		12,100		▲ 20,000	

当座預金残高	5,651,100	5,663,200	5,643,200
準備預金残高	4,970,100		
積み終了先	4,969,600		
超過準備	4,969,600		
非準備預金先	681,000		

4月22日以降の残り所要積立額	
積数	4,800
1日平均	200

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	99.87%	日数	20.00%

●2022年4月21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。一部でレート目線を引き上げる動きが見られたものの、出合いの中心は概ね横ばい圏で推移した。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～▲0.09%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>

21日はTB6M物(第1075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、強含んで推移した。

<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、一部業態から大ロットでの発行も実施された。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

2022/4/21	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.016				－	▲ 0.091
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.095
S/N			▲ 0.003				－	－
1W	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.011				－	▲ 0.098
2W	▲ 0.015	0.005	▲ 0.009				－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.102
1M			▲ 0.010				－	▲ 0.106
3M							▲ 0.108	▲ 0.108
6M							▲ 0.100	▲ 0.111
1Y							▲ 0.080	▲ 0.112

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）
0.245	▲ 0.005	27,553.06	335.21	127.99-00	128.02-03

日付	4/14	4/15	4/18	4/19	4/20
日銀当預残	5,601,800	5,661,300	5,655,600	5,661,300	5,640,000
準備預金残	4,930,400	4,987,300	4,974,100	4,976,700	4,957,500
マネタリーベース	6,848,300	6,908,200	6,902,100	6,908,400	6,888,200
無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.016%	▲0.019%	▲0.017%	▲0.016%
コール市場残高	197,648	167,373	175,874	183,604	190,451
うち無担	171,256	135,837	144,410	152,579	159,689
うちO/N	91,723	69,924	81,742	80,276	80,156
うち有担	26,392	31,536	31,464	31,025	30,762

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1075	－	34,000	2022/4/25	2022/10/25	119,957.0	27,562.6	100.0460	▲0.0917%	73.7669%	100.0460	▲0.0917%	6,437.0
流動性供給	356	－	5,000	2022/4/22		10,205.0	4,999.0		0.0190%	51.6666%		▲0.0090%	
交付税特会	－	－	13,000	2022/5/9	2022/11/2	489,396.0	12,990.41		0.0000%	2.6544%		0.0000%	10.0

●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
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※		2022/4/22			0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/4/21	2022/4/22	▲ 0.350	62	62		▲0.350	▲0.035	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/4/21	2022/4/22	▲ 0.350	100	100		▲0.350	▲0.350	

※国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）の固定利回較差は、0.000%。この結果、10年利付国債366回の買入利回りは、0.250%となる。

●2022年4月22日の予定

*3月の全国消費者物価指数(CPI)
市場予想：前年同月比(除く生鮮)＋0.8%

*国庫短期証券(1076回)入札
(3ヶ月、59,000億円、4/25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