

Central Daily Market Report

2022年4月15日(金)

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15日 需給速報		2022年4月18日 需給予想		2022年4月19日 当社予想	
銀行券	▲ 400		300		▲ 1,000	
財政	58,400		2,300		6,000	
資金過不足	58,000		2,600		5,000	
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		▲ 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		
新型コロナ対応金融支援特別 氣候変動対応オペ						
E T F 買入	500					
国債補完供給	▲ 100	1,200		100		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	59,500		2,400		5,000	
当座預金残高	5,661,300		5,663,700		5,668,700	
準備預金残高	4,987,300					
積み終了先	4,987,300		4月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,987,300		積数		17,300	
非準備預金先	674,000		1日平均		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	99.53%	日数	6.67%		

●2022年4月15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~▲0.001%の出合いで始まった。積み最終日であったため、一部で取り調整の動きが見られた。しかし、全般的には新積み期間にかかる取引のため、警戒感からレートは低下した。一巡後は▲0.025~▲0.015%の出合いが見られた。ターム物はショートターム物の引き合いが見られた。

<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>

15日はTB3M物(第1073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

2022/4/15	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.093	0.240	0.005	27,093.19	▲ 78.81	126.17-20	126.45-48
T/N							-	▲ 0.106						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.107						
2W	▲ 0.035	▲ 0.015	▲ 0.033				-	▲ 0.109						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.110						
1M	▲ 0.020	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.105	▲ 0.114						
6M							▲ 0.111	▲ 0.115						
1Y							▲ 0.105	▲ 0.115						
									日付	4/8	4/11	4/12	4/13	4/14
									日銀当預残	5,588,500	5,596,800	5,600,300	5,579,200	5,601,800
									準備預金残	4,924,600	4,925,300	4,928,500	4,916,700	4,930,400
									マネタリーベース	6,835,000	6,842,500	6,845,900	6,824,400	6,848,300
									無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.010%	▲0.013%
									コール市場残高	223,357	189,708	190,885	189,038	197,648
									うち無担	191,111	163,492	165,503	164,313	171,256
									うちO/N	103,873	76,764	84,740	85,080	91,723
									うち有担	32,246	26,216	25,382	24,725	26,392

●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	1073	-	59,000	2022/4/18	2022/7/25	116,539.5	47,821.40	100.0270	▲0.1005%	58.2692%	100.0303	▲0.1128%	11,178.0

●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
社債等買入	1,000	2022/4/20			1,338	1,001	0.025		0.040	19.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/4/15	2022/4/18	▲0.350	76	76		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/4/15	2022/4/18	▲0.350	0	0				

●2022年4月18日の予定

*2月の石油等消費動態統計

*EURO、London祝日(Easter Monday)

◆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