Central Daily Market Report

2022年3月1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3月1日 需給速報	2022年3月2日 需給予想	2022年3月3日 当社予想
銀行券	▲ 400	▲ 300	0
財政	▲ 31,400	▲ 77,200	3,000
資金過不足	▲ 31,800	▲ 77,500	3,000

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			2,600	▲ 2,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200				
貸出支援基金（成）			7,900	▲ 3,400		
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	▲ 300			300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 32,400		▲ 67,800		3,000	

当座預金残高	5,364,700	5,296,900	5,299,900
準備預金残高	4,693,900		
積み終了先	4,693,500	3月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,693,500	積数	700
非準備預金先	670,800	1日平均	100
積み期間（2/16～3/15）の所要準備額			3,404,800
準備預金進捗率	実績 99.98%	日数	50.00%

●2022年3月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.035～▲0.003%の調達で始まった。調達ニーズは依然強く一巡後も同水準の出合いが継続し本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの出合いが散見される程度であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09～▲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>

1日は短国買入オペが前回から1兆円減額の5,000億円でオファーされ、無難な結果となった。アウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。発行レートは、引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/3/1	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.011				－	▲ 0.086
T/N							－	▲ 0.087
S/N							－	－
1W	▲ 0.045	▲ 0.003	▲ 0.017				－	▲ 0.088
2W	▲ 0.045	0.100	▲ 0.032				－	▲ 0.088
3W			▲ 0.003				－	▲ 0.088
1M							－	▲ 0.098
3M							▲ 0.094	▲ 0.102
6M							▲ 0.090	▲ 0.105
1Y							▲ 0.076	▲ 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）
0.175	▲ 0.005	26,844.72	317.90	115.08-09	115.03-04

日付	2/21	2/22	2/24	2/25	2/28
日銀当預残	5,352,000	5,367,200	5,373,600	5,395,800	5,397,100
準備預金残	4,693,800	4,719,400	4,733,600	4,747,000	4,732,600
マネタリーベース	6,590,700	6,607,500	6,615,000	6,637,800	6,639,400
無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.017%	▲0.017%	▲0.013%	▲0.012%
コール市場残高	197,937	218,949	220,219	200,215	185,170
うち無担	169,167	190,442	192,038	171,982	158,482
うちO/N	96,026	109,261	114,307	74,661	73,619
うち有担	28,770	28,507	28,181	28,233	26,688

●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)	非競争入札(億円)
10年利付国債	365	0.100%	26,000	2022/3/2	2031/12/20	68,349.0	21,126.0	99.2200	0.1800%	57.0000%	99.2300	0.1790%	4,863.0	3.50

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2022/3/2	2022/3/16		2,601	2,601				
国庫短期証券買入	5,000	2022/3/2			20,342	5,002	0.000		0.002	58.1
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/3/1	2022/3/2	▲ 0.350	284	284		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/3/1	2022/3/2	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/3/3	2022/3/10	0.350	2	2				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2022/3/2	2022/3/11		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2022年3月2日の予定

*10-12月期の法人企業統計調査季報
*2月のマネタリーベース
*2月実績/3月見込み財政資金対民間収支
*米国ベージュブック
*ユーロ圏2月の消費者物価指数速報値
*交付税特別会計借入（10,450億円、3/11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