

Central Daily Market Report

2022年3月2日(水)

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2日 需給速報	2022年3月3日 需給予想	2022年3月4日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 1,100	0
財政	▲ 79,100	▲ 7,500	▲ 6,000
資金過不足	▲ 79,400	▲ 8,600	▲ 6,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		12,300	
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	
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ			
E T F買入			
国債補完供給		300	
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 69,700	3,500	▲ 6,000
当座預金残高	5,295,000	5,298,500	5,292,500
準備預金残高	4,630,000		
積み終了先	4,629,700	3月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,629,600	積数	400
非準備預金先	665,000	1日平均	0
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	99.99%	日数
			53.57%

●2022年3月2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▲0.025~▲0.003%の調達で始まった。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>

2日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。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

2022/3/2	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.010				-	▲ 0.085	0.131	▲ 0.044	26,393.03	▲ 451.69	114.84-85	115.15-16
T/N							-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.045	▲ 0.001	▲ 0.027				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.091						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.094	▲ 0.101						
6M							▲ 0.091	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.082	▲ 0.114						
									日付	2/22	2/24	2/25	2/28	3/1
									日銀当預残	5,367,200	5,373,600	5,395,800	5,397,100	5,364,700
									準備預金残	4,719,400	4,733,600	4,747,000	4,732,600	4,694,200
									マネタリーベース	6,607,500	6,615,000	6,637,800	6,639,400	6,607,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.017%	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.011%
									コール市場残高	218,949	220,219	200,215	185,170	190,319
									うち無担	190,442	192,038	171,982	158,482	162,163
									うちO/N	109,261	114,307	74,661	73,619	86,660
									うち有担	28,507	28,181	28,233	26,688	28,156

●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非償格募入札(億円)	非償格募入札(億円)
交付税特会	-	-	10,450	2022/3/11	2022/9/9	430,060.0	10,440.36		0.0000%	2.4277%		0.0000%		10.00

●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)	着札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均着札レート・利回較差・価格較差	貸付比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2022/3/3			6,034	1,500	▲ 0.013		▲ 0.006	14.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/3/3			12,465	4,507	▲ 0.013		▲ 0.010	7.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/3/3			8,535	4,506	▲ 0.027		▲ 0.025	99.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2022/3/3			5,133	1,502	▲ 0.032		▲ 0.030	77.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/2	2022/3/3	▲ 0.350	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/2	2022/3/3	▲ 0.350	0	0				

●2022年3月3日の予定

*中川日銀審議委員、 京都府金融経済懇談会において講演 *2月の消費動向調査 *3月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国1月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国2月のISM非製造業景況指数	*30年利付国債入札 (9,000億円、3/4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