

Central Daily Market Report

2022年3月4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3月4日 需給速報	2022年3月7日 需給予想	2022年3月8日 当社予想
銀行券	▲ 100	100	1,000
財政	▲ 2,000	▲ 12,800	2,000
資金過不足	▲ 2,100	▲ 12,700	3,000

金融調節	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				▲ 300				
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				
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								
当増減	▲ 1,800		▲ 13,100				3,000	

当座預金残高	5,295,000	5,281,900	5,284,900	
準備預金残高	4,638,300			
積み終了先	4,638,200	3月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,638,200	積数	100	
非準備預金先	656,700	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	100.00%	日数	67.86%

●2022年3月4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~▲0.002%の調達で始まった。3日積み取引ということもあり調達ニーズは強く、一巡後も同水準の出合いが継続し取引を終えた。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、▲0.085~▲0.07%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>

4日はTB3M物(第1063回)の入札が実施され、しっかりした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、堅調に推移した。

<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

2022/3/4	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.085	0.150	▲ 0.015	25,985.47	▲ 591.80	115.48-49	115.45-46
T/N							-	▲ 0.083						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.084						
2W			▲ 0.003				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.089						
1M			0.030				-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.090	▲ 0.101						
6M							▲ 0.091	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.085	▲ 0.114						
									日付	2/25	2/28	3/1	3/2	3/3
									日銀当預残	5,395,800	5,397,100	5,364,700	5,295,000	5,296,800
									準備預金残	4,747,000	4,732,600	4,694,200	4,630,000	4,621,900
									マネタリーベース	6,637,800	6,639,400	6,607,400	6,538,000	6,540,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.009%
									コール市場残高	200,215	185,170	190,319	216,333	221,066
									うち無担	171,982	158,482	162,163	188,507	193,172
									うちO/N	74,661	73,619	86,660	107,084	109,144
									うち有担	28,233	26,688	28,156	27,826	27,894

●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	1063	-	57,000	2022/3/7	2022/6/13	115,046.0	46,209.2	100.0230	▲0.0856%	44.8954%	100.0251	▲0.0934%	10,790.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/4	2022/3/7	▲ 0.350	18	18		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/4	2022/3/7	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間1年以上3年以下)	1,250	2022/3/9			2,091	1,252	0.040		0.063	57.1

●2022年3月7日の予定

*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引

*米国1月の消費者信用残高

◆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