

Central Daily Market Report

2022年3月9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9日 需給速報	2022年3月10日 需給予想	2022年3月11日 当社予想	
銀行券	200	▲ 800	▲ 1,000	
財政	▲ 8,200	▲ 200	▲ 7,000	
資金過不足	▲ 8,000	▲ 1,000	▲ 8,000	
金融調節				
	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通				
国債買現	30,300	40,700	▲ 30,300	
国債売現				
国庫短期証買入	5,000			
国債買入		8,900		
CP等買入		▲ 200	▲ 600	
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援				
社債等買入	1,300	▲ 200		
新型コロナウイルス対応金融支援特別				
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給		200		
※ドル資金供給用担保提供				
当預増減	28,400	17,700	▲ 8,000	
当座預金残高	5,312,700	5,330,400	5,322,400	
準備預金残高	4,644,600			
積み終了先	4,644,500	3月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,644,500	積数	100	
非準備預金先	668,100	1日平均	0	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			3,406,600	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	78.57%

●2022年3月9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▲0.016~▲0.001%の調達で始まった。前日、国債買現先オペ(T/N)がオファーされた影響もあってか、オファーサイドの資金がやや増加し、過熱感が若干和らぐ展開となった。一巡後は、国債買現先オペ(3/10~16、40,000億円)がオファーされたことで、一部の調達サイドでレートを引き下げる動きが見られた。ターム物はショートタームの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.075%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。また、本日は国債買現先オペがT+1スタート(3/10~3/16)で40,000億円オファーされた。

<短国市場>

9日はTB6M物(第1064回)の入札が実施され、無難な結果となった。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

2022/3/9	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.080	0.160	0.010	24,717.53	▲ 73.42	115.72-74	115.88-89
T/N							-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.004				-	-						
1W							-	▲ 0.086						
2W							-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.089						
1M			0.100				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.091	▲ 0.101						
6M							▲ 0.087	▲ 0.106						
1Y							▲ 0.085	▲ 0.115						
									日付	3/2	3/3	3/4	3/7	3/8
									日銀当預残	5,295,000	5,296,800	5,295,000	5,281,400	5,284,300
									準備預金残	4,630,000	4,621,900	4,636,500	4,629,200	4,630,400
									マネタリーベース	6,538,000	6,540,900	6,539,200	6,525,500	6,528,500
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.007%	▲0.007%
									コール市場残高	216,333	221,066	209,317	188,717	188,336
									うち無担	188,507	193,172	181,378	160,632	159,427
									うちO/N	107,084	109,144	97,490	79,844	82,084
									うち有担	27,826	27,894	27,939	28,085	28,909

●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	1064	-	34,000	2022/3/10	2022/9/12	96,419.0	27,565.7	100.0410	▲0.0804%	72.9028%	100.0420	▲0.0823%	6,434.0

●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(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/3/10			11,859	4,506	0.006		0.007	64.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/3/10			6,976	4,256	0.012		0.014	58.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/9	2022/3/10	▲ 0.350	16	16		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/9	2022/3/10	▲ 0.350	0	0				
国債買現先	40,000	2022/3/10	2022/3/16		76,900	40,004	▲0.100		▲0.097	43.1

●2022年3月10日の予定

*1月の特定サービス産業動態統計速報	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*20年利付国債入札(12,000億円、3/11発行)
*2月の企業物価指数	*米国2月の財政収支	*エネルギー対策借入(5,300億円、3/22借入)
	*米国2月の消費者物価指数	

◆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お客様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