

Central Daily Market Report

2022年3月11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11日 需給速報	2022年3月14日 需給予想	2022年3月15日 当社予想
銀行券	0	400	0
財政	▲ 9,700	4,600	3,000
資金過不足	▲ 9,700	5,000	3,000
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			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入	▲ 300	▲ 400	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
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	▲ 100	100	
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 10,100	4,700	3,000
当座預金残高	5,319,900	5,324,600	5,327,600
準備預金残高	4,655,700		
積み終了先	4,655,600	3月14日以降の残り所要積立額	積数
超過準備	4,655,600		0
非準備預金先	664,200	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
			92.86%

●2022年3月11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~▲0.001%の調達で始まった。積み期終盤のため調達サイドは積みの進捗に応じてまちまちではあるが、必要額を確保した先から順次ビッドをオプする展開となった。ターム物は期内物を中心に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。

<短国市場>

11日はTB3M物(第1065回)の入札が実施され、小甘い結果となった。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。また、本日はCP等買入オペが予定通りの5,000億円でおファーされた。応募額が前回から増加し、按分レートは▲0.03%と前回から上昇した。

●短期金融市場関連指標

2022/3/11	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	▲ 0.010				-	▲ 0.082	0.180	▲ 0.005	25,162.78	▲ 527.62	116.17-20	116.71-73
T/N							-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.007	▲ 0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.086						
2W							-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.084	▲ 0.101						
6M							▲ 0.086	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.084	▲ 0.114						
									日付	3/4	3/7	3/8	3/9	3/10
									日銀当預残	5,295,000	5,281,400	5,284,300	5,312,700	5,330,000
									準備預金残	4,636,500	4,629,200	4,630,400	4,645,300	4,658,800
									マネタリーベース	6,539,200	6,525,500	6,528,500	6,556,700	6,574,700
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.008%
									コール市場残高	209,317	188,717	188,336	212,350	215,152
									うち無担	181,378	160,632	159,427	183,964	186,585
									うちO/N	97,490	79,844	82,084	104,831	101,432
									うち有担	27,939	28,085	28,909	28,386	28,567

●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	1065	-	57,000	2022/3/14	2022/6/20	116,663.0	46,204.1	100.0215	▲0.0800%	4.7875%	100.0235	▲0.0875%	10,795.0

●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	応募総額(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
CP等買入	5,000	2022/3/16			12,943	4,998	▲0.030		▲0.027	80.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/11	2022/3/14	▲0.350	53	53		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/11	2022/3/14	▲0.350	0	0				

●2022年3月14日の予定

*特にありません。

◆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