

Central Daily Market Report

2022年3月14日(月)
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14日 需給速報	2022年3月15日 需給予想	2022年3月16日 当社予想
銀行券	400	300	▲ 1,000
財政	5,100	2,200	▲ 3,000
資金過不足	5,500	2,500	▲ 4,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 2,600
国債買現			▲ 40,700
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入	▲ 400	▲ 800	5,000
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			38,900 ▲ 27,800
被災地支援 社債等買入			
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			
ETF買入			
国債補完供給	▲ 100	100	100
※ドル資金供給用担保提供			
当増減	5,100	1,800	▲ 31,200
当座預金残高	5,325,000	5,326,800	5,295,600
準備預金残高	4,697,700		
積み終了先	4,697,700	3月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,697,700	積数	0
非準備預金先	627,300	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
			96.43%

●2022年3月14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▲0.030~▲0.001%の調達で始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。ターム物は期内物を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%程度での出会い。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>

14日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物と6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/3/14	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	▲ 0.011				-	▲ 0.077	0.190	0.010	25,307.85	145.07	117.54-55	117.72-73
T/N							-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.004				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.095						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.082	▲ 0.101						
6M							▲ 0.084	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.078	▲ 0.112						
									日付	3/7	3/8	3/9	3/10	3/11
									日銀当預残	5,281,400	5,284,300	5,312,700	5,330,000	5,319,900
									準備預金残	4,629,200	4,630,400	4,645,300	4,658,800	4,656,500
									マネタリーベース	6,525,500	6,528,500	6,556,700	6,574,700	6,564,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.007%	▲ 0.007%	▲ 0.007%	▲ 0.008%	▲ 0.010%
									コール市場残高	188,717	188,336	212,350	215,152	209,218
									うち無担	160,632	159,427	183,964	186,585	180,137
									うちO/N	79,844	82,084	104,831	101,432	101,149
									うち有担	28,085	28,909	28,386	28,567	29,081

●入札結果

名称	回数	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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)		2022/3/14	2022/3/15	▲ 0.350	116	116		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/14	2022/3/15	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2022/3/16	2026/3/16	0	38,879

●2022年3月15日の予定

*米国FOMC(1日目)	*流動性供給入札(5,000億円、3/16発行)
*米国2月の生産者物価指数	

◆本資料は信頼できるとさ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