

# Central Daily Market Report

2022年3月15日(火)  
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15日 需給速報	2022年3月16日 需給予想	2022年3月17日 当社予想			
銀行券	300	▲ 600	▲ 1,000			
財政	2,900	▲ 3,400	▲ 2,000			
資金過不足	3,200	▲ 4,000	▲ 3,000			
<b>金融調節</b>	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通			4,300	▲ 2,600		
国債買現				▲ 40,700		
国債売現						
国庫短期証買入			10,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 800	5,000	▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			38,900	▲ 22,500		
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						
E T F買入						
国債補充供給		100				
米ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	2,500	▲ 11,700	▲ 3,000			
当座預金残高	5,327,500	5,315,800	5,312,800			
準備預金残高	4,685,800					
積み終了先	4,685,800			3月16日以降の残り所要積立額	積数	3,775,500
超過準備	4,685,800			積数	1日平均	121,800
非準備預金先	641,700					
積み期間 (3/16~4/15) の所要準備額						3,775,500
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2022年3月15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▲0.010~▲0.001%の調達で始まった。積み最終日にあたることから、一部取り上がる先が見られた。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>

15日は短国買入オペが前回から5,000億円増額の1兆円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは全ゾーンで出会いが見られた。

### <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。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/3/15	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.088	0.205	0.015	25,346.48	38.63	118.21-23	117.97-99
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.040	▲ 0.037	▲ 0.038				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.097						
1M	▲ 0.009	0.010	0.000				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.079	▲ 0.101						
6M							▲ 0.075	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.112						
									日付	3/8	3/9	3/10	3/11	3/14
									日銀当預残	5,284,300	5,312,700	5,330,000	5,319,900	5,325,000
									準備預金残	4,630,400	4,645,300	4,658,800	4,656,500	4,696,700
									マネタリーベース	6,528,500	6,556,700	6,574,700	6,564,600	6,569,300
									無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.007%	▲0.008%	▲0.010%	▲0.011%
									コール市場残高	188,336	212,350	215,152	209,218	179,775
									うち無担	159,427	183,964	186,585	180,137	150,735
									うちO/N	82,084	104,831	101,432	101,149	79,172
									うち有担	28,909	28,386	28,567	29,081	29,040

## ●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)
流動性供給	353	-	5,000	2022/3/16		19,305.0	4,989.0		0.0150%	78.1838%		0.0140%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2022/3/16	2022/3/30		4,251	4,251				
国庫短期証券買入	10,000	2022/3/16			37,607	10,000		0.006	0.006	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/15	2022/3/16	▲ 0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/15	2022/3/16	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/3/17	2022/3/24	0.570	1	1				

## ●2022年3月16日の予定

*2月の貿易統計	*米国FOMC(2日目)	*国庫短期証券(1066回)入札 (1年、35,000億円、3/22発行)
	*米国FRB経済見通し発表	
	*米国1月の企業在庫	
	*米国2月の小売売上高	

◆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