Central Daily Market Report

2022年3月16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16日 需給速報	2022年3月17日 需給予想	2022年3月18日 当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 1,000	▲ 1,000
財政	▲ 3,700	1,000	11,000
資金過不足	▲ 4,300	0	10,000

金融調節	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			13,800			
CP等買入	5,000	▲ 100		▲ 300		
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		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 12,100		13,600		10,000	

当座預金残高	5,315,400	5,329,000	5,339,000
準備預金残高	4,666,700		
積み終了先	3,517,400	3月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,390,900	積数	499,700
非準備預金先	648,700	1日平均	16,700
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	86.76%	日数	3.23%

●2022年3月16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▲0.035～▲0.003%の調達で始まった。積み初日にあたることから立ち上がりのビッド水準にバラつきがあったものの、前積期に続き高いレート水準での出合いとなった。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>

16日はTB1Y物(第1066回)の入札が実施され、弱めの結果となった。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、五・十日発行の前倒し発行にあたり、大型発行も複数実施された。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

2022/3/16	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.013				－	▲ 0.085
T/N			▲ 0.005				－	▲ 0.085
S/N			▲ 0.005				－	－
1W	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004				－	▲ 0.085
2W			▲ 0.005				－	▲ 0.086
3W							－	▲ 0.096
1M	0.001	0.100	0.024				－	▲ 0.099
3M							▲ 0.079	▲ 0.100
6M							▲ 0.080	▲ 0.103
1Y							▲ 0.063	▲ 0.111

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.200	▲ 0.005	25,762.01	415.53	118.31-32	118.37-38

日付	3/9	3/10	3/11	3/14	3/15
日銀当預残	5,312,700	5,330,000	5,319,900	5,325,000	5,327,500
準備預金残	4,645,300	4,658,800	4,656,500	4,696,700	4,684,700
マネタリーベース	6,556,700	6,574,700	6,564,600	6,569,300	6,571,400
無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.008%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.008%
コール市場残高	212,350	215,152	209,218	179,775	160,074
うち無担	183,964	186,585	180,137	150,735	132,593
うちO/N	104,831	101,432	101,149	79,172	61,200
うち有担	28,386	28,567	29,081	29,040	27,481

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1066	－	35,000	2022/3/22	2023/3/20	95,899.0	28,376.1	100.0550	**▲0.0552%**	**20.9719%**	100.0600	**▲0.0602%**	6,623.0

●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	2022/3/17			10,666	4,505	▲0.003		▲0.001	16.3
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,500	2022/3/17			8,337	4,512	▲0.008		▲0.007	43.5
国債買入（残存期間5年超10年以下）	4,250	2022/3/17			6,750	4,254	▲0.010		▲0.008	85.7
国債買入（残存期間25年超）	500	2022/3/17			1,705	502	▲0.012		▲0.010	37.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/3/16	2022/3/17	▲ 0.350	51	51		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/3/16	2022/3/17	▲ 0.350	0	0				

●2022年3月17日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合
（1日目、18日まで）
*10-12月期の資金循環統計速報
*1月の機械受注統計
市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲2.2%
*米国2月の住宅着工件数
*米国2月の鉱工業生産・設備稼働率
*ユーロ圏2月の消費者物価指数改定値
*英中銀MPC結果発表
*国庫短期証券(1067回)入札
（3ヶ月、57,000億円、3/22発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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