Central Daily Market Report

2022年3月18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18日 需給速報		2022年3月22日 需給予想		2022年3月23日 当社予想	
銀行券	▲ 600		100		0	
財政	14,000		63,100		1,000	
資金過不足	13,400		63,200		1,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 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		▲ 400				
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	▲ 200	600		200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	12,900		62,800		1,000	

当座預金残高	5,340,100	5,402,900	5,403,900
準備預金残高	4,691,100		
積み終了先	4,690,900		
超過準備	4,688,500		
非準備預金先	649,000		

3月22日以降の残り所要積立額	
積数	6,500
1日平均	300

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	99.83%	日数 19.35%

●2022年3月18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▲0.020～▲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合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、▲0.08～▲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>

18日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M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。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●入札結果

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。

●2022年3月21日の予定　●2022年3月22日の予定

*春分の日　　*特にありません。

●短期金融市場関連指標

2022/3/18	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	▲ 0.006				－	▲ 0.083
T/N							－	▲ 0.083
S/N							－	－
1W	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.003				－	▲ 0.084
2W							－	▲ 0.091
3W			▲ 0.001				－	▲ 0.094
1M							－	▲ 0.097
3M			0.230				▲ 0.082	▲ 0.099
6M							▲ 0.083	▲ 0.103
1Y							▲ 0.065	▲ 0.110

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)
0.205	0.005	26,827.43	174.54	118.49-50	118.85-87

日付	3/11	3/14	3/15	3/16	3/17
日銀当預残	5,319,900	5,325,000	5,327,500	5,315,400	5,327,200
準備預金残	4,656,500	4,696,700	4,684,700	4,666,900	4,683,800
マネタリーベース	6,564,600	6,569,300	6,571,400	6,559,900	6,572,800
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.011%	▲0.008%	▲0.013%	▲0.009%
コール市場残高	209,218	179,775	160,074	197,809	208,878
うち無担	180,137	150,735	132,593	170,082	180,621
うちO/N	101,149	79,172	61,200	86,924	90,658
うち有担	29,081	29,040	27,481	27,727	28,257

●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）		2022/3/18	2022/3/22	▲ 0.350	235	235		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/3/18	2022/3/22	▲ 0.350	0	0				

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定。

（1）長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）（賛成8反対1）

次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

（2）資産買入れ方針（全員一致）

長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。

①ETFおよびJ-REITについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。

②CP等、社債等については、2022年3月末までの間、合計で約20兆円の残高を上限に、買入れを行う。同年4月以降は、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準（CP等：約2兆円、社債等：約3兆円）へと徐々に戻していく。

2. 日本銀行は、2%の「物価安定の目標」の実現を目指し、これを安定的に持続するために必要な時点まで、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続する。

マネタリーベースについては、消費者物価指数（除く生鮮食品）の前年比上昇率の実績値が安定的に2%を超えるまで、拡大方針を継続する。

引き続き、①新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム、②国債買入れやドルオペなどによる円貨および外貨の上限を設けない潤沢な供給、③それぞれ約12兆円および約1,800億円の年間増加ペースの上限のもとでのETFおよびJ-REITの買入れにより、企業等の資金繰り支援と金融市場の安定維持に努めていく。

当面、新型コロナウイルス感染症の影響を注視し、必要があれば、躊躇なく追加的な金融緩和措置を講じる。政策金利については、現在の長短金利の水準、または、それを下回る水準で推移することを想定している。

◆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