

Central Daily Market Report

2022年3月22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22日 需給速報	2022年3月23日 需給予想	2022年3月24日 当社予想			
銀行券	100	▲ 400	▲ 1,000			
財政	60,200	5,600	▲ 2,000			
資金過不足	60,300	5,200	▲ 3,000			
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		20,000				
国債買入						
CP等買入		▲ 600	▲ 300			
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						
国債補完供給	▲ 200	200	200			
*ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	59,700	25,100	▲ 3,000			
当座預金残高	5,399,800	5,424,900	5,421,900			
準備預金残高	4,744,200					
積み終了先	4,744,000			3月23日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,744,000			積数	6,300	
非準備預金先	655,600			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	22.58%		

●2022年3月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.015~▲0.001%での調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートタームでの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>

22日は短国買入オペが前回から1兆円増額の2兆円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/3/22	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	▲ 0.005				-	▲ 0.084	0.215	0.010	27,224.11	396.68	119.58-59	120.47-48
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.085						
2W	0.010	0.150	0.080				-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.082	▲ 0.099						
6M							▲ 0.083	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.064	▲ 0.111						
									日付	3/14	3/15	3/16	3/17	3/18
									日銀当預残	5,325,000	5,327,500	5,315,400	5,327,200	5,340,100
									準備預金残	4,696,700	4,684,700	4,666,900	4,683,800	4,692,000
									マネタリーベース	6,569,300	6,571,400	6,559,900	6,572,800	6,586,300
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.008%	▲0.013%	▲0.009%	▲0.006%
									コール市場残高	179,775	160,074	197,809	208,878	218,476
									うち無担	150,735	132,593	170,082	180,621	189,508
									うちO/N	79,172	61,200	86,924	90,658	101,680
									うち有担	29,040	27,481	27,727	28,257	28,968

●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	案分率	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
国庫短期証券買入	20,000	2022/3/23			67,444	20,003	0.003		0.004	12.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/22	2022/3/23	▲ 0.350	215	215		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/22	2022/3/23	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/3/24	2022/3/31	0.580	0	0				

●2022年3月23日の予定

*1月の景気動向指数改訂状況	*米国2月の新築一戸建て販売件数
	*英国2月の消費者物価指数

◆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お客様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