

Central Daily Market Report

2022年3月23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23日 需給速報	2022年3月24日 需給予想	2022年3月25日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 1,200	▲ 1,000
財政	1,800	14,600	41,000
資金過不足	1,500	13,400	40,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		13,400	
CP等買入		▲ 300	▲ 400
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			
国債補充供給	▲ 100	200	100
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	21,300	26,500	40,000
当座預金残高	5,421,100	5,447,600	5,487,600
準備預金残高	4,775,300		
積み終了先	4,775,100		3月24日以降の残り所要積立額
超過準備	4,775,100		積数 6,000
非準備預金先	645,800		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	99.84%	日数 25.81%

●2022年3月23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。前日比でレート水準に変化はなく、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、▲0.090~▲0.080%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>

23日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は五・十日発行にあたり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あった。

●短期金融市場関連指標

2022/3/23	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	▲ 0.006				-	▲ 0.084	0.220	0.005	28,040.16	816.05	121.34-35	121.06-07
T/N							-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.005	0.001	0.000				-	▲ 0.085						
2W							-	▲ 0.092						
3W							-	▲ 0.094						
1M							-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.082	▲ 0.098						
6M							▲ 0.083	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.064	▲ 0.111						
									日付	3/15	3/16	3/17	3/18	3/22
									日銀当預残	5,327,500	5,315,400	5,327,200	5,340,100	5,399,800
									準備預金残	4,684,700	4,666,900	4,683,800	4,692,000	4,745,200
									マネタリーベース	6,571,400	6,559,900	6,572,800	6,586,300	6,645,900
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.013%	▲0.009%	▲0.006%	▲0.005%
									コール市場残高	160,074	197,809	208,878	218,476	210,792
									うち無担	132,593	170,082	180,621	189,508	181,534
									うちO/N	61,200	86,924	90,658	101,680	95,701
									うち有担	27,481	27,727	28,257	28,968	29,258

●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)	残札総額 (億円・ 百万ドル)	抜付レート ・利回差 ・価格差	全取レート ・利回差 ・価格差	平均残札レート ・利回差 ・価格差	抜付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/3/24			8,759	4,502	▲0.007		▲0.004	9.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/3/24			9,522	4,509	▲0.002		▲0.001	58.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/3/24			10,647	4,256	0.003		0.004	80.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/23	2022/3/24	▲ 0.350	70	70		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/23	2022/3/24	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2022/3/28			2,099	750	0.223		0.272	14.7

●2022年3月24日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(1月17・18日分)	*米国2月の耐久財新規受注	*国庫短期証券(1068回)入札 (6ヶ月、34,000億円、3/25発行)
		*流動性供給入札 (4,000億円、3/25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