

# Central Daily Market Report

2022年3月24日(木)  
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24日 需給速報	2022年3月25日 需給予想	2022年3月28日 当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 200	0
財政	14,300	34,200	8,000
資金過不足	13,100	34,000	8,000
<b>金融調節</b>			
	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			
国債買入	13,400		
CP等買入		▲ 400	▲ 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			800
新型コロナウイルス対応金融支援特別			▲ 241,800
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 300	100	300
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	25,900	33,700	▲ 233,000
当座預金残高	5,447,000	5,480,700	5,247,700
準備預金残高	4,799,500		
積み終了先	4,799,500		3月25日以降の残り所要積立額
超過準備	4,799,500		積数 6,000
非準備預金先	647,500		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	99.84%	日数 29.03%

## ●2022年3月24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▲0.01~▲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、▲0.095~▲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>

24日はTB6M物の入札が実施され、無難な結果となった。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発行市場は複数の発行が観測され、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

2022/3/24	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.095	0.230	0.010	28,110.39	70.23	121.12-14	121.62-64
T/N							-	▲ 0.089						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W	▲ 0.004	0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.092						
2W							-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.094						
1M	▲ 0.003	0.001	▲ 0.001				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.082	▲ 0.098						
6M			0.010				▲ 0.083	▲ 0.103						
1Y							▲ 0.064	▲ 0.111						
									日付	3/16	3/17	3/18	3/22	3/23
									日銀当預残	5,315,400	5,327,200	5,340,100	5,399,800	5,421,100
									準備預金残	4,666,900	4,683,800	4,692,000	4,745,200	4,773,500
									マネタリーベース	6,559,900	6,572,800	6,586,300	6,645,900	6,667,500
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.009%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.006%
									コール市場残高	197,809	208,878	218,476	210,792	229,066
									うち無担	170,082	180,621	189,508	181,534	199,522
									うちO/N	86,924	90,658	101,680	95,701	110,119
									うち有担	27,727	28,257	28,968	29,258	29,544

## ●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)
国庫短期証券	1068	-	34,000	2022/3/25	2022/9/26	108,123.0	27,562.6	100.0390	▲0.0769%	61.0473%	100.0390	▲0.0769%	6,437.0
流動性供給	354	-	4,000	2022/3/25		16,229.0	3,991.00		0.0000%	17.0668%		▲0.0020%	

## ●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)		2022/3/24	2022/3/25	▲ 0.350	260	260		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/24	2022/3/25	▲ 0.350	0	0				

## ●2022年3月25日の予定

\*月例経済報告  
\*2月の企業向けサービス価格指数  
\*3月の都区部消費者物価指数(CPI)  
市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.6%

\*国庫短期証券(1069回)入札  
(3ヶ月、57,000億円、3/28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