

Central Daily Market Report

2022年3月25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25日 需給速報	2022年3月28日 需給予想	2022年3月29日 当社予想
銀行券	▲ 300	100	0
財政	33,000	6,600	5,000
資金過不足	32,700	6,700	5,000
金融調節			
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	▲ 600	▲ 200	
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 気候変動対応オペ		287,700	▲ 241,800
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 300	300	300
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	32,100	53,500	5,000
当座預金残高	5,479,100	5,532,600	5,537,600
準備預金残高	4,829,100		
積み終了先	4,829,000		3月28日以降の残り所要積立額
超過準備	4,829,000		積数 5,600
非準備預金先	650,000		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	99.85%	日数 38.71%

●2022年3月25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▲0.008~▲0.001%での調達で始まった。前日比でレート水準は上昇し、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、今週の取引を終えた。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>

25日はTB3M物の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。その他のカレント銘柄では、1Y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あった。

●短期金融市場関連指標

2022/3/25	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.004				-	▲ 0.087	0.235	0.005	28,149.84	39.45	122.34-36	121.73-75
T/N							-	▲ 0.088						
S/N			▲ 0.003				-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.092						
2W							-	▲ 0.093						
3W			▲ 0.003				-	▲ 0.095						
1M			0.480				-	▲ 0.098						
3M							▲ 0.087	▲ 0.099						
6M							▲ 0.085	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.111						
									日付	3/17	3/18	3/22	3/23	3/24
									日銀当預残	5,327,200	5,340,100	5,399,800	5,421,100	5,447,000
									準備預金残	4,683,800	4,692,000	4,745,200	4,773,500	4,799,800
									マネタリーベース	6,572,800	6,586,300	6,645,900	6,667,500	6,694,600
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.005%
									コール市場残高	208,878	218,476	210,792	229,066	224,452
									うち無担	180,621	189,508	181,534	199,522	195,279
									うちO/N	90,658	101,680	95,701	110,119	102,996
									うち有担	28,257	28,968	29,258	29,544	29,173

●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	1069	-	57,000	2022/3/28	2022/7/4	135,704.0	46,204.4	100.0215	▲0.0800%	84.8845%	100.0219	▲0.0815%	10,795.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/25	2022/3/28	▲ 0.350	183	183		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/25	2022/3/28	▲ 0.350	73	73		▲ 0.350	▲ 0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2022/3/28時点の貸出残高(億円)
新型コロナウイルス対応金融支援特別	2022/3/28	2022/9/28	0	287,713	868,372

●2022年3月28日の予定

*特にありません。

◆本資料は信頼できるとさ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