

Central Daily Market Report

2022年3月29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29日 需給速報	2022年3月30日 需給予想	2022年3月31日 当社予想
銀行券	▲ 700	▲ 200	600
財政	11,100	12,900	34,400
資金過不足	10,400	12,700	35,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		5,100	▲ 4,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		20,000	
国債買入	600	5,200	
CP等買入	▲ 400	▲ 300	5,000
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入			
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ			
E T F 買入		100	
国債補完供給	▲ 100	300	100
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	10,800	38,600	40,000
当座預金残高	5,540,300	5,578,900	5,618,900
準備預金残高	4,887,500		
積み終了先	4,886,800		3月30日以降の残り所要積立額
超過準備	4,886,800		積数
非準備預金先	652,800		1日平均
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	99.88%	日数
			45.16%

●2022年3月29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。前日比でレート水準に変化はなく、一巡後は▲0.05~▲0.001%程度のレートで散発的な出合いが見られ、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、▲0.100~▲0.095%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>

29日は短国買入オペが前回と同額の2兆円でオファーされ、しっかりとした結果となった。マーケットではオペのオファー額据え置きが好感され、1Y物にやや強めの出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、期末日となり多くの業態から入札が実施された。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/3/29	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	▲ 0.004				-	▲ 0.100	0.245	▲ 0.005	28,252.42	308.53	123.59-61	123.57-59
T/N	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.103						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.101						
1M			▲ 0.013				-	▲ 0.102						
3M			0.005				▲ 0.089	▲ 0.100						
6M							▲ 0.085	▲ 0.103						
1Y							▲ 0.073	▲ 0.109						
									日付	3/22	3/23	3/24	3/25	3/28
									日銀当預残	5,399,800	5,421,100	5,447,000	5,479,100	5,529,500
									準備預金残	4,745,200	4,773,500	4,799,800	4,828,500	4,869,400
									マネタリーベース	6,645,900	6,667,500	6,694,600	6,726,900	6,777,400
									無担O/N加重平均	▲0.005%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.004%	▲0.004%
									コール市場残高	210,792	229,066	224,452	233,704	217,333
									うち無担	181,534	199,522	195,279	203,577	187,893
									うちO/N	95,701	110,119	102,996	106,164	90,945
									うち有担	29,258	29,544	29,173	30,127	29,440

●入札結果

名称	回数	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)
40年利付国債	14	0.700%	6,000	2022/3/30	2061/3/20	13,158.0	5,998.00	87.5000	1.0950%	77.6000%			

●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	買付利率	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	落札レート・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	落付比率
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2022/3/30	2022/4/13		5,101	5,101				
国庫短期証券買入	20,000	2022/3/30			26,468	20,005	▲0.005		0.000	26.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/29	2022/3/30	▲ 0.350	90	90		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/29	2022/3/30	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/3/31	2022/4/7	0.590	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/3/30			2,426	2,426				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/3/30			2,860	2,860				

※1 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.000%。この結果、10年利付国債365回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※2 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)の固定利回較差は、0.000%。この結果、10年利付国債365回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年3月30日の予定

*2月の商業動態統計速報

*米国10-12月期のGDP確報値

◆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