

# Central Daily Market Report

2022年3月30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30日 需給速報	2022年3月31日 需給予想	2022年4月1日 当社予想
銀行券	▲ 100	0	▲ 1,000
財政	10,700	43,300	▲ 29,000
資金過不足	10,600	43,300	▲ 30,000
<b>金融調節</b>			
	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	5,200	23,100	
CP等買入		▲ 300	5,000 ▲ 9,000
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	100		
国債補充供給	▲ 300	100	300
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	36,200	62,700	▲ 30,000
当座預金残高	5,576,500	5,639,200	5,609,200
準備預金残高	4,945,700		
積み終了先	4,944,700		3月31日以降の残り所要積立額
超過準備	4,944,600		積数 3,400
非準備預金先	630,800		1日平均 200
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	99.91%	日数 48.39%

## ●2022年3月30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。引き続き調達サイドのニーズは強く、レート水準は横ばい圏で推移した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物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、▲0.300~▲0.130%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>

30日のアウトライイト市場では特段の出合いは見られなかったものの、3Mゾーンを中心にしっかりとした買い気配が見られた。

### <CP市場>

CP市場は、大型を中心に期明けの発行が複数実施された。発行レートは、横ばいであった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/3/30	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.004					-	▲ 0.098	0.213	▲ 0.032	28,027.25	▲ 225.17	123.11-13	121.86-88
T/N								-	▲ 0.300						
S/N			▲ 0.003					-	-						
1W	▲ 0.001	0.001	0.000					-	▲ 0.121						
2W			0.000					-	▲ 0.111						
3W								-	▲ 0.108						
1M			0.000					-	▲ 0.104						
3M								▲ 0.105	▲ 0.102						
6M								▲ 0.085	▲ 0.103						
1Y								▲ 0.075	▲ 0.109						
										日付	3/23	3/24	3/25	3/28	3/29
										日銀当預残	5,421,100	5,447,000	5,479,100	5,529,500	5,540,300
										準備預金残	4,773,500	4,799,800	4,828,500	4,869,400	4,887,500
										マネタリーベース	6,667,500	6,694,600	6,726,900	6,777,400	6,788,800
										無担O/N加重平均	▲ 0.006%	▲ 0.005%	▲ 0.004%	▲ 0.004%	▲ 0.004%
										コール市場残高	229,066	224,452	233,704	217,333	219,755
										うち無担	199,522	195,279	203,577	187,893	189,313
										うちO/N	110,119	102,996	106,164	90,945	97,325
										うち有担	29,544	29,173	30,127	29,440	30,442

## ●入札結果

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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	6,000	2022/3/31			7,832	6,001	▲0.035		▲0.026	19.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	7,250	2022/3/31			15,104	7,254	▲0.020		▲0.019	79.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2022/3/31			4,164	1,504	▲0.035		▲0.030	89.6
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2022/3/31			2,589	1,002	▲0.060		▲0.059	99.6
国債買入(物価連動債)	600	2022/3/31			1,250	600	0.080		▲0.057	10.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/3/31			9,602	5,001	▲0.055		▲0.039	24.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2022/3/31			3,525	1,003	▲0.050		▲0.046	35.3
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/3/31			2,406	502	▲0.093		▲0.084	86.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/30	2022/3/31	▲ 0.350	313	313		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/30	2022/3/31	▲ 0.350	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/3/31			0	0				

※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、0.005%。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31日の予定

*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 市場予想:前月比+0.5%	*米国2月の個人所得・消費支出 *米国3月のシカゴPM景況感指数 *英国10-12月期のGDP確報値	*2年利付国債入札 (28,000億円、4/1発行)
------------------------------------	--	-------------------------------

◆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