

# Central Daily Market Report

2022年3月3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3日 需給速報	2022年3月4日 需給予想	2022年3月7日 当社予想			
銀行券	▲ 1,100	▲ 100	1,000			
財政	▲ 8,900	▲ 1,300	▲ 14,000			
資金過不足	▲ 10,000	▲ 1,400	▲ 13,000			
<b>金融調節</b>	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
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	12,300					
CP等買入		▲ 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						
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						
国債補完供給	▲ 300		300			
*ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	1,800	▲ 1,100	▲ 13,000			
当座預金残高	5,296,800	5,295,700	5,282,700			
準備預金残高	4,621,800					
積み終了先	4,621,800			3月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,621,600			積数	200	
非準備預金先	675,000			1日平均	0	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						3,404,800
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	57.14%		

## ●2022年3月3日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.022~▲0.001%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが継続し、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの出合いが散見される程度であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.08%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>

3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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/3/3	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.084	0.165	0.034	26,577.27	184.24	115.51-52	115.72-74
T/N							-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.001				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.001	0.050	0.008				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.092						
1M							-	▲ 0.100						
3M							▲ 0.094	▲ 0.101						
6M							▲ 0.091	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.082	▲ 0.114						
									日付	2/24	2/25	2/28	3/1	3/2
									日銀当預残	5,373,600	5,395,800	5,397,100	5,364,700	5,295,000
									準備預金残	4,733,600	4,747,000	4,732,600	4,694,200	4,630,000
									マネタリーベース	6,615,000	6,637,800	6,639,400	6,607,400	6,538,000
									無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.013%	▲0.012%	▲0.011%	▲0.010%
									コール市場残高	220,219	200,215	185,170	190,319	216,333
									うち無担	192,038	171,982	158,482	162,163	188,507
									うちO/N	114,307	74,661	73,619	86,660	107,084
									うち有担	28,181	28,233	26,688	28,156	27,826

## ●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)
30年利付国債	73	0.700%	9,000	2022/3/4	2051/12/20	22,484.0	7,211.0	95.4000	0.8950%	32.1513%	95.4500	0.8930%	1,782.0

## ●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)		2022/3/3	2022/3/4	▲ 0.350	275	275		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/3	2022/3/4	▲ 0.350	12	12		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2022年3月4日の予定

\*1月の完全失業率(市場予想:2.7%)

\*米国2月の雇用統計

\*1月の有効求人倍率(市場予想:1.16倍)

\*国庫短期証券(1063回)入札

(3ヶ月、57,000億円、3/7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