

Central Daily Market Report

2022年3月7日(月)

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7日 需給速報	2022年3月8日 需給予想	2022年3月9日 当社予想
銀行券	100	▲ 100	0
財政	▲ 13,300	800	▲ 8,000
資金過不足	▲ 13,200	700	▲ 8,000
金融調節			
	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			
CP等買入	▲ 300	▲ 100	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入	▲ 100		1,300
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	
国債補完供給			
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 13,600	700	▲ 6,700
当座預金残高	5,281,400	5,282,100	5,275,400
準備預金残高	4,630,200		
積み終了先	4,630,100	3月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,630,100	積数	100
非準備預金先	651,200	1日平均	0
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額			3,406,600
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			71.43%

●2022年3月7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▲0.017~▲0.001%の調達で始まった。一般的に資金調達ニーズが強い地合いが継続している。ターム物はショートタームの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.075~▲0.065%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>

7日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、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

2022/3/7	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.082	0.140	▲ 0.010	25,221.41	▲ 764.06	114.94-95	115.01-03
T/N							-	▲ 0.077						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004				-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.006	▲ 0.005	▲ 0.005				-	▲ 0.085						
3W							-	▲ 0.087						
1M							-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.090	▲ 0.101						
6M							▲ 0.091	▲ 0.106						
1Y							▲ 0.085	▲ 0.115						
									日付	2/28	3/1	3/2	3/3	3/4
									日銀当預残	5,397,100	5,364,700	5,295,000	5,296,800	5,295,000
									準備預金残	4,732,600	4,694,200	4,630,000	4,621,900	4,636,500
									マネタリーベース	6,639,400	6,607,400	6,538,000	6,540,900	6,539,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.009%
									コール市場残高	185,170	190,319	216,333	221,066	209,317
									うち無担	158,482	162,163	188,507	193,172	181,378
									うちO/N	73,619	86,660	107,084	109,144	97,490
									うち有担	26,688	28,156	27,826	27,894	27,939

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/3/7	2022/3/8	▲ 0.350	10	10		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/7	2022/3/8	▲ 0.350	0	0				

●2022年3月8日の予定

*1月の毎月勤労統計調査速報	*米国1月の貿易収支	*5年利付国債入札(25,000億円、3/9発行)
*1月の国際収支	*米国1月の卸売売上高	
*1月の景気動向指数速報	*ユーロ圏10-12月期のGDP確報値	
*2月の景気ウオッチャー調査		

◆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