

Central Daily Market Report

2022年3月17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17日 需給速報	2022年3月18日 需給予想	2022年3月22日 当社予想			
銀行券	▲ 1,100	▲ 600	0			
財政	▲ 100	13,900	58,000			
資金過不足	▲ 1,200	13,300	58,000			
金融調節						
	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	13,800					
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 400		
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 600	100		600		
*ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	11,800		13,000		58,000	
当座預金残高	5,327,200		5,340,200		5,398,200	
準備預金残高	4,683,300					
積み終了先	4,667,100				3月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,200,700				積数	17,000
非準備預金先	643,900				1日平均	600
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	99.55%	日数	6.45%		

●2022年3月17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▲0.030~▲0.001%の調達で始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。ターム物は期内物を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%程度での出会い。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>

17日はTB3M物(第1067回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。

<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。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/3/17	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.085	0.200	0.000	26,652.89	890.88	118.86-88	118.66-68
T/N			▲ 0.003				-	▲ 0.085						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.030	0.020	▲ 0.007				-	▲ 0.090						
3W							-	▲ 0.094						
1M			0.170				-	▲ 0.097						
3M							▲ 0.080	▲ 0.099						
6M							▲ 0.083	▲ 0.103						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.111						
									日付	3/10	3/11	3/14	3/15	3/16
									日銀当預残	5,330,000	5,319,900	5,325,000	5,327,500	5,315,400
									準備預金残	4,658,800	4,656,500	4,696,700	4,684,700	4,666,900
									マネタリーベース	6,574,700	6,564,600	6,569,300	6,571,400	6,559,900
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.008%	▲0.013%
									コール市場残高	215,152	209,218	179,775	160,074	197,809
									うち無担	186,585	180,137	150,735	132,593	170,082
									うちO/N	101,432	101,149	79,172	61,200	86,924
									うち有担	28,567	29,081	29,040	27,481	27,727

●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	1067	-	57,000	2022/3/22	2022/6/27	126,603.0	46,243.9	100.0200	▲0.0752%	98.7396%	100.0206	▲0.0774%	10,755.0

●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)		2022/3/17	2022/3/18	▲ 0.350	540	540		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/3/17	2022/3/18	▲ 0.350	0	0				

●2022年3月18日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)

*米国2月の中古住宅販売

*黒田日銀総裁定例会見

*2月の全国消費者物価指数(CPI)

市場予想: 前年同月比(除く生鮮)+0.6%

*1月の第3次産業活動動向

◆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。

◆本資料は何ら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