

# Central Daily Market Report

2022年3月31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31日<br>需給速報 | 2022年4月1日<br>需給予想 | 2022年4月4日<br>当社予想 |                |           |     |
|-------------------------------|--------------------|-------------------|-------------------|----------------|-----------|-----|
| 銀行券                           | 100                | ▲ 300             | 2,000             |                |           |     |
| 財政                            | 45,000             | ▲ 31,900          | ▲ 18,000          |                |           |     |
| 資金過不足                         | 45,100             | ▲ 32,200          | ▲ 16,000          |                |           |     |
| 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                          | 23,100             |                   |                   |                |           |     |
| CP等買入                         | 5,000              | ▲ 9,000           |                   |                |           |     |
| 貸出支援基金(成)                     |                    |                   |                   |                |           |     |
| 貸出支援基金(貸)                     |                    |                   |                   |                |           |     |
| 被災地支援<br>社債等買入                |                    |                   |                   |                |           |     |
| 新型コロナウイルス対応金融支援特別<br>気候変動対応オペ |                    |                   |                   |                |           |     |
| E T F 買入                      |                    |                   | 600               |                |           |     |
| 国債補完供給                        | ▲ 9,200            | 300               | 9,200             |                |           |     |
| ※ドル資金供給用担保提供特約                |                    |                   |                   |                |           |     |
| 当預増減                          | 55,300             | ▲ 22,400          | ▲ 16,000          |                |           |     |
| 当座預金残高                        | 5,631,800          | 5,609,400         | 5,593,400         |                |           |     |
| 準備預金残高                        | 5,006,500          |                   |                   |                |           |     |
| 積み終了先                         | 5,006,500          |                   |                   | 4月1日以降の残り所要積立額 |           |     |
| 超過準備                          | 5,003,400          |                   |                   | 積数             | 200       |     |
| 非準備預金先                        | 625,300            |                   |                   | 1日平均           | 0         |     |
| 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                 | 99.99%            | 日数                | 51.61%         |           |     |

## ●2022年3月31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▲0.03~▲0.005%の出会いとなった。期末初の取引となり調達を見送った先が多く、ギブン地合いとなるなか出会いレートは大幅に低下した。一巡後は▲0.04~▲0.01%台の出会いが少額見られた程度で本日の取引を終えた。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、▲0.120~▲0.100%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>

31日のアウトライト市場は動意なく閑散なか、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP市場は、入札案件に乏しく閑散であった。

## ●短期金融市場関連指標

| 2022/3/31 | 無担(速報)  |         |         | 有担(速報) |    |    | 短国 | 東京<br>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       | ▲ 0.080 | 0.001   | ▲ 0.020 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.264   | 0.210     | ▲ 0.003   | 27,821.43 | ▲ 205.82  | 122.02-04 | 121.63-65 |
| T/N       |         |         | ▲ 0.200 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.126   |           |           |           |           |           |           |
| S/N       |         |         |         |        |    |    |    | -           | -         |           |           |           |           |           |           |
| 1W        |         |         | 0.001   |        |    |    |    | -           | ▲ 0.111   |           |           |           |           |           |           |
| 2W        | ▲ 0.040 | ▲ 0.001 | ▲ 0.021 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.109   |           |           |           |           |           |           |
| 3W        |         |         |         |        |    |    |    | -           | ▲ 0.107   |           |           |           |           |           |           |
| 1M        |         |         |         |        |    |    |    | -           | ▲ 0.107   |           |           |           |           |           |           |
| 3M        |         |         |         |        |    |    |    | ▲ 0.105     | ▲ 0.102   |           |           |           |           |           |           |
| 6M        |         |         |         |        |    |    |    | ▲ 0.085     | ▲ 0.103   |           |           |           |           |           |           |
| 1Y        |         |         |         |        |    |    |    | ▲ 0.075     | ▲ 0.108   |           |           |           |           |           |           |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | 日付        | 3/24      | 3/25      | 3/28      | 3/29      | 3/30      |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | 日銀当預残     | 5,447,000 | 5,479,100 | 5,529,500 | 5,540,300 | 5,576,500 |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | 準備預金残     | 4,799,800 | 4,828,500 | 4,869,400 | 4,887,500 | 4,945,700 |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | マネタリーベース  | 6,694,600 | 6,726,900 | 6,777,400 | 6,788,800 | 6,825,200 |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.005%  | ▲ 0.004%  | ▲ 0.004%  | ▲ 0.004%  | ▲ 0.004%  |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | コール市場残高   | 224,452   | 233,704   | 217,333   | 219,755   | 222,906   |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | うち無担      | 195,279   | 203,577   | 187,893   | 189,313   | 193,389   |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | うちO/N     | 102,996   | 106,164   | 90,945    | 97,325    | 112,416   |
|           |         |         |         |        |    |    |    |             |           | うち有担      | 29,173    | 30,127    | 29,440    | 30,442    | 29,517    |

## ●入札結果

| 名称     | 回数  | 表面<br>利率 | 発行<br>予定額 | 発行日      | 償還日      | 応募額<br>(億円) | 募入額<br>(億円) | 募入<br>最低額 | 募入最高利回・利<br>回較差 | 案分率      | 募入<br>平均価格 | 募入平均利回・利<br>回較差 | 第1非価格<br>競争入札(億円) |
|--------|-----|----------|-----------|----------|----------|-------------|-------------|-----------|-----------------|----------|------------|-----------------|-------------------|
| 2年利付国債 | 435 | 0.005%   | 28,000    | 2022/4/1 | 2024/4/1 | 123,302.0   | 22,721.0    | 100.0550  | ▲0.0220%        | 29.0225% | 100.0620   | ▲0.0250%        | 5,273.0           |

## ●オペ結果

| 種類                          | オファー額<br>(億円・<br>百万ドル) | スタート日     | エンド日     | 貸付<br>利率 | 応札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 落札総額<br>(億円・<br>百万ドル) | 按分レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 全取レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 平均落札レート<br>・利回較差<br>・価格較差 | 按分<br>比率 |
|-----------------------------|------------------------|-----------|----------|----------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|----------|
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)   |                        | 2022/3/31 | 2022/4/1 | ▲ 0.550  | 9,077                 | 9,077                 |                         | ▲ 0.550                 | ▲ 0.582                   |          |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)   |                        | 2022/3/31 | 2022/4/1 | ▲ 0.550  | 87                    | 87                    |                         | ▲ 0.550                 | ▲ 0.550                   |          |
| 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下) |                        | 2022/4/1  |          |          | 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、0.037%。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4月1日の予定

|  |  |  |
|--|--|--|
| *3月調査の日銀短観(概要及び要旨)<br>市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI)+12 | *米国3月の雇用統計<br>*米国2月の建設支出<br>*米国3月のISM製造業業況指数<br>*ユーロ圏3月の消費者物価指数速報値 | *国庫短期証券(1070回)入札<br>(3ヶ月、57,000億円、4/4発行)<br>*交付税特別会計借入<br>(13,000億円、4/8借入) |
|--|--|--|

◆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