

# Central Daily Market Report

2022年2月14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2月14日 需給速報	2022年2月15日 需給予想	2022年2月16日 当社予想	
銀行券	800	900	1,000	
財政	▲ 26,400	108,400	▲ 26,000	
資金過不足	▲ 25,600	109,300	▲ 25,000	
<b>金融調節</b>				
貸出				
全店共通			▲ 2,800	
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入				
CP等買入	▲ 600	▲ 300	5,000	
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				
国債補完供給	▲ 500	400	500	
*ドル資金供給用担保提供				
当預増減	▲ 26,300	109,500	▲ 22,800	
当座預金残高	5,259,900	5,369,400	5,346,600	
準備預金残高	4,667,200			
積み終了先	4,667,200	2月15日以降の残り所要積立額	0	
超過準備	4,667,200	積数	0	
非準備預金先	592,700	1日平均	0	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,777,100	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.77%

## ●2022年2月14日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、立ち上がりは邦銀業態からの調達を中心に、▲0.04~▲0.001%の水準での出会い。一部で調整により取り上がる動きも見られた。一巡後は▲0.08~▲0.01%近辺のレンジで推移し、本日の取引を終えた。ターム物はショートターム物の引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.075%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>

14日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物と1Y物に出合いが見られた。

### <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

2022/2/14	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.087	0.215	▲ 0.010	27,079.59	▲ 616.49	115.58-60	115.40-42
T/N							-	▲ 0.082						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.085						
2W	▲ 0.039	▲ 0.003	▲ 0.033				-	▲ 0.086						
3W	▲ 0.010	0.150	0.004				-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.091	▲ 0.102						
6M							▲ 0.094	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.124						
									日付	2/4	2/7	2/8	2/9	2/10
									日銀当預残	5,269,200	5,266,700	5,261,100	5,267,100	5,286,200
									準備預金残	4,673,200	4,668,500	4,668,900	4,672,800	4,695,800
									マネタリーベース	6,508,600	6,505,600	6,499,700	6,505,500	6,524,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.022%
									コール市場残高	205,465	200,695	204,317	200,790	209,806
									うち無担	175,764	171,550	175,373	171,822	180,499
									うちO/N	103,093	102,009	107,242	103,611	114,228
									うち有担	29,701	29,145	28,944	28,968	29,307

## ●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	案分率	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)		2022/2/14	2022/2/15	▲ 0.350	492	492		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/14	2022/2/15	▲ 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)		2022/2/15			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、0.025%。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2月15日の予定

*10-12月期のGDP1次速報 市場予想：前期比年率 5.8%	*米国1月の生産者物価指数 *ユーロ圏10-12月期のGDP2次速報	*5年利付国債入札 (25,000億円、2/16発行) *国有林野借入 (958億円、2/25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