

# Central Daily Market Report

2022年2月15日(火)  
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15日 需給速報	2022年2月16日 需給予想	2022年2月17日 当社予想	
銀行券	800	▲ 100	▲ 1,000	
財政	105,700	12,700	▲ 1,000	
資金過不足	106,500	12,600	▲ 2,000	
<b>金融調節</b>				
	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通		2,600	▲ 2,800	
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入		5,000		
国債買入				
CP等買入	▲ 300	5,000	▲ 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				
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	▲ 200	500	200	
米ドル資金供給用担保提供供給				
当預増減	106,500	22,100	▲ 2,000	
当座預金残高	5,366,400	5,388,500	5,386,500	
準備預金残高	4,732,700			
積み終了先	4,732,700	2月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,732,700	積数	3,404,800	
非準備預金先	633,700	1日平均	121,600	
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	0.00%	日数	0.00%

## ●2022年2月15日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.025~▲0.001%の出会いで始まった。積み最終日の着地に向けた調整により、全般的に取り上がる動きが見られた。一巡後は▲0.08~▲0.001%の出会いが散見された。ターム物は1~2W物の引き合いが見られた。

### <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>

15日は短国買入オペが前回と同額(5,000億円)オファーされ、甘めの結果となった。マーケットは動意なく閑散な中、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。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/2/15	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	▲ 0.010				-	▲ 0.085	0.210	▲ 0.005	26,865.19	▲ 214.40	115.53-55	115.34-35
T/N			▲ 0.008				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.003	0.010	0.002				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.004	▲ 0.002	▲ 0.035				-	▲ 0.087						
3W	▲ 0.010	0.190	0.057				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.040	0.150	▲ 0.002				-	▲ 0.092						
3M			0.005				▲ 0.091	▲ 0.102						
6M							▲ 0.091	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.091	▲ 0.124						
									日付	2/7	2/8	2/9	2/10	2/14
									日銀当預残	5,266,700	5,261,100	5,267,100	5,286,200	5,259,900
									準備預金残	4,668,500	4,668,900	4,672,800	4,695,800	4,667,000
									マネタリーベース	6,505,600	6,499,700	6,505,500	6,524,600	6,497,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.022%	▲ 0.019%
									コール市場残高	200,695	204,317	200,790	209,806	165,437
									うち無担	171,550	175,373	171,822	180,499	135,720
									うちO/N	102,009	107,242	103,611	114,228	70,139
									うち有担	29,145	28,944	28,968	29,307	29,717

## ●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)
5年利付国債	150	0.005%	25,000	2022/2/16	2026/12/20	68,243.0	20,153.0	99.8100	0.0440%	89.0225%	99.8300	0.0400%	4,839.0
国有林野借入	-	-	958	2022/2/25	2027/2/25	6,249.0	957.99		0.0000%	33.3340%		0.0000%	

## ●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2022/2/16	2022/3/2		2,551	2,551				
国庫短期証券買入	5,000	2022/2/16			21,964	5,002	0.007		0.007	83.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/15	2022/2/16	▲ 0.350	150	150		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/15	2022/2/16	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/2/17	2022/2/25	0.340	1	1				

## ●2022年2月16日の予定

*12月の第3次産業活動指数	*米国12月の企業在庫
*12月の石油等消費動態統計	*米国1月の小売売上高
	*米国1月の鉱工業生産・設備稼働率
	*英国1月の消費者物価指数

◆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