

Central Daily Market Report

2022年2月16日(水)
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16日 需給速報		2022年2月17日 需給予想		2022年2月18日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 900		▲ 1,000	
財政	13,200		1,600		▲ 9,000	
資金過不足	13,100		700		▲ 10,000	
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	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			9,400			
CP等買入	5,000	▲ 500		▲ 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	▲ 200	200		200		
*ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	22,400		9,900		▲ 10,000	
当座預金残高	5,388,800		5,398,700		5,388,700	
準備預金残高	4,727,200					
積み終了先	3,587,300		2月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	1,577,400		積数		255,000	
非準備預金先	661,600		1日平均		9,400	
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	92.51%	日数	3.57%		

●2022年2月16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▲0.06~▲0.01%の出会いで始まった。新しい積み期間に入ったものの、引き続き地銀業態を中心に調達意欲は旺盛なことから、レート低下は小幅に止まった。一巡後は▲0.08~▲0.02%の出会いで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>

16日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物と6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行の前倒し発行にあたり、一部で大型発行も見られた。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/2/16	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.024				-	▲ 0.084	0.215	0.005	27,460.40	595.21	115.64-65	115.64-65
T/N			▲ 0.008				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.050	▲ 0.001	▲ 0.036				-	▲ 0.087						
3W			0.000				-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.009				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.090	▲ 0.102						
6M							▲ 0.086	▲ 0.113						
1Y							▲ 0.082	▲ 0.124						
									日付	2/8	2/9	2/10	2/14	2/15
									日銀当預残	5,261,100	5,267,100	5,286,200	5,259,900	5,366,400
									準備預金残	4,668,900	4,672,800	4,695,800	4,667,000	4,732,700
									マネタリーベース	6,499,700	6,505,500	6,524,600	6,497,600	6,603,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.022%	▲ 0.019%	▲ 0.010%
									コール市場残高	204,317	200,790	209,806	165,437	169,111
									うち無担	175,373	171,822	180,499	135,720	139,432
									うちO/N	107,242	103,611	114,228	70,139	74,851
									うち有担	28,944	28,968	29,307	29,717	29,679

●入札結果

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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/2/17			13,355	4,508	0.005		0.006	41.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/2/17			8,361	4,256	0.002		0.005	65.5
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/2/17			2,539	506	0.027		0.027	52.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/16	2022/2/17	▲ 0.350	166	166		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/16	2022/2/17	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
被災地金融支援オペ 第15回	2022/2/18	2024/2/16	0	0

●2022年2月17日の予定

*12月の機械受注統計
市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲1.8%
*1月の貿易統計

*米国1月の住宅着工件数

*国庫短期証券(1059回)入札
(1年、35,000億円、2/21発行)
*20年利付国債入札
(12,000億円、2/18発行)
*交付税特別会計借入
(11,000億円、2/28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