

Central Daily Market Report

2022年2月18日(金)
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18日 需給速報	2022年2月21日 需給予想	2022年2月22日 当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 200	▲ 1,000
財政	1,900	▲ 47,100	2,000
資金過不足	1,300	▲ 47,300	1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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			
CP等買入	▲ 400	▲ 300	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入			800
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	100		
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	1,000	▲ 47,600	1,800
当座預金残高	5,401,100	5,353,500	5,355,300
準備預金残高	4,744,200		
積み終了先	4,743,700	2月21日以降の残り所要積立額	積数 4,200
超過準備	4,742,200	積数	1日平均 200
非準備預金先	656,900		
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	99.88%	日数 17.86%

●2022年2月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末3日積み要因により全般的に取り上がる動きが見られ、国内勢を中心に▲0.06~▲0.008%の出会い。一巡後は▲0.08~▲0.01%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>

18日はTB3M物(第1060回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。この他に、6M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部で大型発行も見られたが案件は少なかった。発行レートは横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/2/18	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 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	▲ 0.018					-	▲ 0.086	0.215	▲ 0.005	27,122.07	▲ 110.80	114.85-87	115.11-13
T/N			▲ 0.008					-	▲ 0.085						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.012	0.250	0.016					-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.010					-	▲ 0.087						
3W								-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.010					-	▲ 0.092						
3M								▲ 0.085	▲ 0.098						
6M								▲ 0.082	▲ 0.108						
1Y								▲ 0.067	▲ 0.118						
										日付	2/10	2/14	2/15	2/16	2/17
										日銀当預残	5,286,200	5,259,900	5,366,400	5,388,800	5,400,100
										準備預金残	4,695,800	4,667,000	4,732,700	4,727,600	4,734,200
										マネタリーベース	6,524,600	6,497,600	6,603,200	6,625,600	6,637,900
										無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.019%	▲ 0.010%	▲ 0.024%	▲ 0.022%
										コール市場残高	209,806	165,437	169,111	193,834	192,837
										うち無担	180,499	135,720	139,432	164,906	163,866
										うちO/N	114,228	70,139	74,851	98,245	95,945
										うち有担	29,307	29,717	29,679	28,928	28,971

●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	1060	-	57,000	2022/2/21	2022/5/30	129,359.0	46,209.3	100.0205	▲0.0763%	1.7558%	100.0220	▲0.0819%	10,790.0

●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)		2022/2/18	2022/2/21	▲ 0.350	35	35		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/18	2022/2/21	▲ 0.350	0	0				

●2022年2月21日の予定

*New York祝日(Presidents' Day)

◆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