

Central Daily Market Report

2022年2月21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21日 需給速報	2022年2月22日 需給予想	2022年2月24日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 1,700	▲ 1,000
財政	▲ 47,700	3,100	▲ 5,000
資金過不足	▲ 48,000	1,400	▲ 6,000
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		13,300	
CP等買入	▲ 300	▲ 100	
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	▲ 200
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	▲ 800	800	
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 49,100	16,000	▲ 6,000
当座預金残高	5,352,000	5,368,000	5,362,000
準備預金残高	4,693,800		
積み終了先	4,693,300		2月22日以降の残り所要積立額
超過準備	4,693,300		積数
非準備預金先	658,200		1日平均
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	99.89%	日数
			21.43%

●2022年2月21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▲0.045~▲0.008%の調達で始まった。週明けの取引となったものの、引き続き調達ニーズは強く、先週末と概ね横ばいの出会い水準となった。一巡後も朝方と同水準の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲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>

21日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、入札件数が少なく閑散であった。発行レートは、銘柄によりまちまちであった。

●短期金融市場関連指標

2022/2/21	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				-	▲ 0.086	0.205	▲ 0.010	26,910.87	▲ 211.20	114.95-97	114.92-94
T/N	▲ 0.005	0.001	▲ 0.004				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.009				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.089						
1M							-	▲ 0.094						
3M			0.150				▲ 0.085	▲ 0.098						
6M							▲ 0.080	▲ 0.108						
1Y							▲ 0.069	▲ 0.116						
									日付	2/14	2/15	2/16	2/17	2/18
									日銀当預残	5,259,900	5,366,400	5,388,800	5,400,100	5,401,100
									準備預金残	4,667,000	4,732,700	4,727,600	4,734,200	4,744,200
									マネタリーベース	6,497,600	6,603,200	6,625,600	6,637,900	6,639,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.010%	▲ 0.024%	▲ 0.022%	▲ 0.018%
									コール市場残高	165,437	169,111	193,834	192,837	208,138
									うち無担	135,720	139,432	164,906	163,866	178,830
									うちO/N	70,139	74,851	98,245	95,945	108,099
									うち有担	29,717	29,679	28,928	28,971	29,308

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/2/22			13,548	4,504	▲0.007		▲0.004	17.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/2/22			7,658	4,504	▲0.015		▲0.014	73.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/2/22			7,995	4,255	▲0.016		▲0.014	68.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/21	2022/2/22	▲ 0.350	777	777		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/21	2022/2/22	▲ 0.350	20	20		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2022年2月22日の予定

*1月の企業向けサービス価格指数	*米国12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*流動性供給入札(5,000億円、2/24発行)
	*米国2月のCB消費者信頼感指数	*交付税特別会計借入(10,500億円、3/4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