

Central Daily Market Report

2022年2月22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22日 需給速報	2022年2月24日 需給予想	2022年2月25日 当社予想			
銀行券	▲ 1,600	▲ 1,000	▲ 1,000			
財政	2,500	▲ 5,700	3,000			
資金過不足	900	▲ 6,700	2,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入		15,000				
国債買入	13,300					
CP等買入		▲ 100	▲ 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	▲ 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						
国債補充供給	▲ 300	800	300			
※ドル資金供給用担保提供						
当預増減	15,200	8,300	2,000			
当座預金残高	5,367,200	5,375,500	5,377,500			
準備預金残高	4,718,300					
積み終了先	4,717,900			2月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,717,900			積数	2,900	
非準備預金先	648,900			1日平均	100	
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	99.91%	日数	28.57%		

●2022年2月22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▲0.04~▲0.005%程度の調達で始まった。祝日前で2日積みの取引となり、引き続き強い調達ニーズを受け、レートは前日比で僅かに上昇した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.08%程度での出合い。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>

22日は短国買入オペが前回から1兆円増額の1兆5,000億円でオファーされた。平均は若干甘めだったものの、按分は流れており、無難な結果となった。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、3か月物を中心に複数の入札が実施された。発行レートは、一部の銘柄で積極的な応札があったものの、概ね横ばいであった。CP等買入オペは、応札額8,078億円、足切りレート▲0.040%、平均落札レート▲0.023%といずれも前回から低下した。

●短期金融市場関連指標

2022/2/22	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	▲ 0.017				-	▲ 0.087	0.190	▲ 0.015	26,449.61	▲ 461.26	114.60-61	114.73-75
T/N			▲ 0.005				-	▲ 0.089						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004				-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.002				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.010	0.070	▲ 0.003				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.085	▲ 0.098						
6M			0.020				▲ 0.080	▲ 0.107						
1Y							▲ 0.067	▲ 0.116						
									日付	2/15	2/16	2/17	2/18	2/21
									日銀当預残	5,366,400	5,388,800	5,400,100	5,401,100	5,352,000
									準備預金残	4,732,700	4,727,600	4,734,200	4,744,200	4,693,800
									マネタリーベース	6,603,200	6,625,600	6,637,900	6,639,400	6,590,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.024%	▲ 0.022%	▲ 0.018%	▲ 0.019%
									コール市場残高	169,111	193,834	192,837	208,138	197,937
									うち無担	139,432	164,906	163,866	178,830	169,167
									うちO/N	74,851	98,245	95,945	108,099	96,026
									うち有担	29,679	28,928	28,971	29,308	28,770

●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非償還額募入札(億円)	非償還額募入札(億円)
流動性供給	352	-	5,000	2022/2/24		19,378.0	4,975.0		▲0.0160%	29.3070%		▲0.0170%		
交付税特会	-	-	10,500	2022/3/4	2022/9/2	426,488.0	10,490.36		0.0000%	2.4598%		0.0000%		10.00

●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
国庫短期証券買入	15,000	2022/2/24			35,088	15,002	0.001		0.005	49.5
CP等買入	5,000	2022/2/28			8,078	4,993	▲0.040		▲0.023	11.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/22	2022/2/24	▲ 0.350	326	326		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/22	2022/2/24	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/2/25	2022/3/3	0.340	3	3				

●2022年2月23日の予定

*天皇誕生日

*ユーロ圏1月の消費者物価指数改定値

●2022年2月24日の予定

*米国10-12月期のGDP改定値

*米国1月の新築一戸建て販売件数

*国庫短期証券(1061回)入札

(6ヶ月、34,000億円、2/25発行)

◆本資料は信頼できるとさ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