

Central Daily Market Report

2022年2月24日(木)

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24日 需給速報	2022年2月25日 需給予想	2022年2月28日 当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 700	▲ 1,000
財政	▲ 7,200	9,500	▲ 6,000
資金過不足	▲ 8,400	8,800	▲ 7,000
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	15,000		
国債買入		9,400	
CP等買入		▲ 300	▲ 800
貸出支援基金(成)			5,000
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 400
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		600	
国債補完供給	▲ 200	300	200
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	6,400	17,800	▲ 197,800
当座預金残高	5,373,600	5,391,400	5,193,600
準備預金残高	4,733,600		
積み終了先	4,733,300		2月25日以降の残り所要積立額
超過準備	4,733,300		積数 2,500
非準備預金先	640,000		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	99.93%	日数 32.14%

●2022年2月24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~▲0.008%の調達で始まった。引き続き調達サイドのニーズは強く、レート水準は横ばい圏で推移した。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での引き合いが散見された。

<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>

24日はTB6M物(第1061回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発6M物に特段の出合いは見られなかったものの、堅調に推移した。この他、1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、多くの発行体から入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏ながらも、期間によって足切水準の違いが見られた。

●2022年2月25日の予定

- *12月の景気動向指数改訂状況
- *2月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+0.4%)
- *米国1月の耐久財新規受注 *米国1月の個人所得・消費支出
- *国庫短期証券(1062回)入札(3ヶ月、57,000億円、2/28発行)
- *2年利付国債入札(30,000億円、3/1発行)
- *交付税特別会計借入(10,500億円、3/8借入)

●短期金融市場関連指標

2022/2/24	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	▲ 0.017					-	▲ 0.087	0.185	▲ 0.005	25,970.82	▲ 478.79	114.89-90	114.61-62
T/N	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004					-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.008	0.150	0.006					-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.008					-	▲ 0.088						
3W								-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.009	0.230	0.001					-	▲ 0.095						
3M								▲ 0.085	▲ 0.098						
6M								▲ 0.088	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.072	▲ 0.115						
										日付	2/16	2/17	2/18	2/21	2/22
										日銀当預残	5,388,800	5,400,100	5,401,100	5,352,000	5,367,200
										準備預金残	4,727,600	4,734,200	4,744,200	4,693,800	4,719,400
										マネタリーベース	6,625,600	6,637,900	6,639,400	6,590,700	6,607,500
										無担O/N加重平均	▲ 0.024%	▲ 0.022%	▲ 0.018%	▲ 0.019%	▲ 0.017%
										コール市場残高	193,834	192,837	208,138	197,937	218,949
										うち無担	164,906	163,866	178,830	169,167	190,442
										うちO/N	98,245	95,945	108,099	96,026	109,261
										うち有担	28,928	28,971	29,308	28,770	28,507

●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	1061	-	34,000	2022/2/25	2022/8/25	112,662.0	27,565.9	100.0380	▲0.0766%	71.6600%	100.0380	▲0.0766%	6,434.0

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/2/25			10,867	4,506	0.005		0.006	39.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/2/25			8,953	4,257	0.010		0.011	74.0
国債買入(物価連動債)	600	2022/2/25			1,295	601	0.300		0.021	11.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/24	2022/2/25	▲ 0.350	220	220		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/24	2022/2/25	▲ 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・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	本則第47回	2022/3/2		7,922	16
成長基盤強化	米ドル特則第39期	2022/3/4		1,022	11
成長基盤強化	米ドル特則第35期(借り換え)	2022/3/4		1,195	11
成長基盤強化	米ドル特則第31期(借り換え)	2022/3/4		46	13
成長基盤強化	米ドル特則第27期(借り換え)	2022/3/4		106	5

◆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