

# Central Daily Market Report

2022年2月25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25日 需給速報	2022年2月28日 需給予想	2022年3月1日 当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 200	0
財政	14,200	▲ 5,000	▲ 35,000
資金過不足	13,600	▲ 5,200	▲ 35,000
<b>金融調節</b>			
	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	9,400		
CP等買入	▲ 800	5,000	▲ 5,400
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	▲ 400		▲ 300
新型コロナ対応金融支援特別		205,000	▲ 195,800
気候変動対応オペ			
E T F買入	600		
国債補完供給	▲ 400	200	400
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	22,200	3,700	▲ 35,000
当座預金残高	5,395,800	5,399,500	5,364,500
準備預金残高	4,744,800		
積み終了先	4,744,500		2月28日以降の残り所要積立額
超過準備	4,744,500		積数 1,400
非準備預金先	651,000		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	99.96%	日数 42.86%

## ●2022年2月25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%の調達で始まった。週末3日積みを受けて、調達サイドの取り上がる動きが加速し、レート水準は前日比で上昇した。一巡後は▲0.035~▲0.01%のレンジの出合いが見られ、今週の取引を終えた。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>

25日はTB3M物(第1062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、底堅く推移した。この他、1Y物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は、大型を含めて複数の発行体から入札が実施された。発行レートは、概ね横ばいであった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/2/25	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	▲ 0.013				-	▲ 0.087	0.205	0.020	26,476.50	▲ 505.68	115.54-56	115.27-29
T/N							-	▲ 0.089						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.001				-	▲ 0.089						
3W			▲ 0.005				-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.010				-	▲ 0.094						
3M			0.180				▲ 0.087	▲ 0.099						
6M							▲ 0.088	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.073	▲ 0.114						
									日付	2/17	2/18	2/21	2/22	2/24
									日銀当預残	5,400,100	5,401,100	5,352,000	5,367,200	5,373,600
									準備預金残	4,734,200	4,744,200	4,693,800	4,719,400	4,733,600
									マネタリーベース	6,637,900	6,639,400	6,590,700	6,607,500	6,615,000
									無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.018%	▲0.019%	▲0.017%	▲0.017%
									コール市場残高	192,837	208,138	197,937	218,949	220,219
									うち無担	163,866	178,830	169,167	190,442	192,038
									うちO/N	95,945	108,099	96,026	109,261	114,307
									うち有担	28,971	29,308	28,770	28,507	28,181

## ●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1062	-	57,000	2022/2/28	2022/6/6	143,073.0	46,209.6	100.0225	▲0.0837%	97.6211%	100.0243	▲0.0904%	10,790	
2年利付国債	434	0.005%	30,000	2022/3/1	2024/3/1	110,264.0	24,188.0	100.0450	▲0.0170%	0.8465%	100.0510	▲0.0200%	5,803	
交付税特会	-	-	10,500	2022/3/8	2023/9/6	407,555.0	10,490.42		0.0000%	2.5740%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/25	2022/2/28	▲ 0.350	422	422		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/25	2022/2/28	▲ 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)	(参考)2022/2/28時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2022/2/28	2022/8/31	0	204,990	822,470

## ●2022年2月28日の予定

*1月の商業動態統計速報	*米国2月のシカゴPM景況感指
*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲0.7%)	
*1月の住宅着工統計	

◆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