

Central Daily Market Report

2022年2月28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28日 需給速報	2022年3月1日 需給予想	2022年3月2日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 400	0
財政	▲ 7,300	▲ 34,100	▲ 76,000
資金過不足	▲ 7,600	▲ 34,500	▲ 76,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 2,600
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入	5,000	▲ 5,400	▲ 200
貸出支援基金(成)			7,900
貸出支援基金(貸)			▲ 4,000
被災地支援 社債等買入		▲ 300	▲ 100
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	205,000	▲ 195,800	
E T F 買入			
国債補完供給		400	
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	1,300	▲ 34,800	▲ 74,700
当座預金残高	5,397,100	5,362,300	5,287,600
準備預金残高	4,732,600		
積み終了先	4,732,200		3月1日以降の残り所要積立額
超過準備	4,732,200		積数
非準備預金先	664,500		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	99.97%	日数
			46.43%

●2022年2月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.035~▲0.005%の調達で始まった。月末日であるものの、調達ニーズは依然強く、一巡後も同水準の出合いが継続し本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの出合いが散見される程度であった。

<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>

28日のアウトライト市場では、3M物と1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。発行レートは、引き続き低位で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/2/28	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	▲ 0.012				-	▲ 0.087	0.180	▲ 0.025	26,526.82	50.32	115.58-60	115.49-51
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.008	0.005	▲ 0.004				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.094	▲ 0.100						
6M							▲ 0.090	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.076	▲ 0.114						
									日付	2/18	2/21	2/22	2/24	2/25
									日銀当預残	5,401,100	5,352,000	5,367,200	5,373,600	5,395,800
									準備預金残	4,744,200	4,693,800	4,719,400	4,733,600	4,747,000
									マネタリーベース	6,639,400	6,590,700	6,607,500	6,615,000	6,637,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.019%	▲ 0.017%	▲ 0.017%	▲ 0.013%
									コール市場残高	208,138	197,937	218,949	220,219	200,215
									うち無担	178,830	169,167	190,442	192,038	171,982
									うちO/N	108,099	96,026	109,261	114,307	74,661
									うち有担	29,308	28,770	28,507	28,181	28,233

●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	棄分率	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/28	2022/3/1	▲ 0.350	27	27		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/28	2022/3/1	▲ 0.350	0	0				

●2022年3月1日の予定

*米国1月の建設支出	*10年利付国債入札
*米国2月のISM製造業景況指数	(26,000億円、3/2発行)

◆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。

◆本資料は何ら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