

Central Daily Market Report

2022年2月17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17日 需給速報	2022年2月18日 需給予想	2022年2月21日 当社予想
銀行券	▲ 900	▲ 400	▲ 1,000
財政	3,100	400	▲ 40,000
資金過不足	2,200	0	▲ 41,000
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	9,400		
CP等買入		▲ 500	▲ 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			
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	100		
国債補完供給	▲ 100	200	100
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	11,300	▲ 300	▲ 41,000
当座預金残高	5,400,100	5,399,800	5,358,800
準備預金残高	4,734,100		
積み終了先	4,728,300		2月18日以降の残り所要積立額
超過準備	4,489,500		積数 10,400
非準備預金先	666,000		1日平均 400
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 99.69%	日数 7.14%	

●2022年2月17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▲0.06~▲0.01%の出会いで始まった。積みの序盤ながら、引き続き地銀業態の調達ニーズは強く、前営業日対比で横ばいの推移となった。一巡後は▲0.08~▲0.01%台の出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は1~2W物の引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.085~▲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＞

17日はTB1Y物(第1059回)の入札が実施され、弱い結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は、五・十日発行の後ろ倒し発行にあたり、大型発行も複数見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/2/17	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	0.150	▲ 0.022				-	▲ 0.086	0.220	0.005	27,232.87	▲ 227.53	115.39-40	115.29-31
T/N	▲ 0.008	▲ 0.005	▲ 0.007				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.010	0.050	0.006				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.035	▲ 0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M			▲ 0.002				-	▲ 0.092						
3M							▲ 0.090	▲ 0.100						
6M							▲ 0.082	▲ 0.110						
1Y							▲ 0.067	▲ 0.119						
									日付	2/9	2/10	2/14	2/15	2/16
									日銀当預残	5,267,100	5,286,200	5,259,900	5,366,400	5,388,800
									準備預金残	4,672,800	4,695,800	4,667,000	4,732,700	4,727,600
									マネタリーベース	6,505,500	6,524,600	6,497,600	6,603,200	6,625,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.022%	▲ 0.019%	▲ 0.010%	▲ 0.024%
									コール市場残高	200,790	209,806	165,437	169,111	193,834
									うち無担	171,822	180,499	135,720	139,432	164,906
									うちO/N	103,611	114,228	70,139	74,851	98,245
									うち有担	28,968	29,307	29,717	29,679	28,928

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1059	-	35,000	2022/2/21	2023/2/20	80,256.0	29,376.7	100.0490	▲0.0491%	46.1531%	100.0550	▲0.0551%	5,623.0	
20年利付国債	179	0.500%	12,000	2022/2/18	2041/12/20	32,932.0	9,710.0	95.8500	0.7390%	67.1546%	95.9100	0.7360%	2,283.0	
交付税特会	-	-	11,000	2022/2/28	2022/8/31	444,316.0	10,990.33		0.0000%	2.4736%		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)		2022/2/17	2022/2/18	▲ 0.350	147	147		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/17	2022/2/18	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2022/2/22			1,639	751	0.233		0.272	11.8

●2022年2月18日の予定

*1月の全国消費者物価指数(CPI) 市場予想：前年同月比(除く生鮮)+0.3%	*米国1月の中古住宅販売	*国庫短期証券(1060回)入札 (3ヶ月、57,000億円、2/21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