

Central Daily Market Report

2022年1月31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1月31日 需給速報	2022年2月1日 需給予想	2022年2月2日 当社予想
銀行券	400	800	1,000
財政	▲ 200	▲ 27,200	▲ 96,000
資金過不足	200	▲ 26,400	▲ 95,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 3,000
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	▲ 4,000	
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	123,500	▲ 132,200	
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 200	300	200
※ドル資金供給用担保提供供給			
当増減	▲ 7,400	▲ 26,200	▲ 98,000
当座預金残高	5,390,800	5,364,600	5,266,600
準備預金残高	4,775,600		
積み終了先	4,775,200	2月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,775,200	積数	800
非準備預金先	615,200	1日平均	100
積み期間 (1/16~2/15) の所要準備額			3,779,800
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数
			51.61%

●2022年1月31日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.07~▲0.001%での調達で始まった。月末要因によりオファー・ビッド双方で動けない先が見られたものの、先週と横ばい圏の展開となった。一巡後は▲0.07~▲0.015%程度の出合いが見られた。ターム物に関しては目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.090~▲0.080%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>

31日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、入札件数が乏しく閑散としていた。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/1/31	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	▲ 0.021				-	▲ 0.085	0.170	0.005	27,001.98	284.64	115.26-27	115.42-43
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.003	▲ 0.025				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.008				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.100	▲ 0.103						
6M							▲ 0.098	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.098	▲ 0.124						
									日付	1/24	1/25	1/26	1/27	1/28
									日銀当預残	5,352,100	5,376,500	5,370,400	5,391,600	5,398,200
									準備預金残	4,725,500	4,754,600	4,748,500	4,776,100	4,782,300
									マネタリーベース	6,594,200	6,617,900	6,611,600	6,633,400	6,639,700
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.021%	▲0.021%	▲0.021%	▲0.021%
									コール市場残高	188,549	200,260	193,926	200,449	201,684
									うち無担	171,246	182,682	176,460	182,713	184,397
									うちO/N	102,553	101,849	95,837	101,780	105,104
									うち有担	17,303	17,578	17,466	17,736	17,287

●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	案分率	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)		2022/1/31	2022/2/1	▲ 0.350	233	233		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/31	2022/2/1	▲ 0.350	0	0				

●2022年2月1日の予定

*12月の完全失業率(市場予想:2.8%)	*米国12月の建設支出	*10年利付国債入札 (26,000億円、2/2発行)
*12月の有効求人倍率(市場予想:1.16倍)	*米国1月のISM製造業景況指数	*交付税特別会計借入 (11,000億円、2/10借入)

◆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