

Central Daily Market Report

2022年2月1日(火)

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1日 需給速報	2022年2月2日 需給予想	2022年2月3日 当社予想
銀行券	700	600	1,000
財政	▲ 29,300	▲ 101,500	0
資金過不足	▲ 28,600	▲ 100,900	1,000

金融調節	スタート		エンド		スタート		エンド	
	貸出	貸入	貸出	貸入	貸出	貸入	貸出	貸入
全店共通			2,800	▲ 3,000				
国債買現								
国債売現								
国庫短期証買入			5,000					
国債買入								
CP等買入								
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								
国債補完供給	▲ 100	200		100				
米ドル資金供給用担保提供								

当預増減	▲ 28,500	▲ 96,000	1,000
------	----------	----------	-------

当座預金残高	5,362,300	5,266,300	5,267,300
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,747,600		
積み終了先	4,747,300	2月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,747,300	積数	400
非準備預金先	614,700	1日平均	0

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	99.99%	日数	54.84%
---------	----	--------	----	--------

●2022年2月1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▲0.065~▲0.001%での調達で始まった。月末要因が剥落したものの、レート水準に大きな変化はなく、一巡後は▲0.04~▲0.015%程度のレートで散發的な出会いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、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、▲0.090~▲0.080%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>

1日は短国買入オベが前回と同額(5,000億円)オファーされ、甘めの結果となった。アウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2022/2/1 単位: %	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	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	▲ 0.020				-	▲ 0.085	0.180	0.010	27,078.48	76.50	115.12-13	114.93-95
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.032				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.040	0.200	▲ 0.014				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M			0.000				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.100	▲ 0.102						
6M							▲ 0.098	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.098	▲ 0.124						

日付	1/25	1/26	1/27	1/28	1/31
日銀当預残	5,376,500	5,370,400	5,391,600	5,398,200	5,390,800
準備預金残	4,754,600	4,748,500	4,776,100	4,782,300	4,775,600
マネタリーベース	6,617,900	6,611,600	6,633,400	6,639,700	6,631,900
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	200,260	193,926	200,449	201,684	170,881
うち無担	182,682	176,460	182,713	184,397	153,825
うちO/N	101,849	95,837	101,780	105,104	81,872
うち有担	17,578	17,466	17,736	17,287	17,056

●入札結果

名称	回数	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)
10年利付国債	365	0.100%	26,000	2022/2/2	2031/12/20	68,905.0	21,080.0	99.2600	0.1760%	97.0987%	99.2700	0.1750%	4.897	13.85
交付税特会	-	-	11,000	2022/2/10	2022/8/10	466,378.0	10,990.40		0.0000%	2.3566%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2022/2/2	2022/2/16		2,781	2,781				
国庫短期証券買入	5,000	2022/2/2			20,279	5,002	0.005		0.006	75.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/1	2022/2/2	▲ 0.350	86	86		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/1	2022/2/2	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/2/3	2022/2/10	0.340	0	0				

●2022年2月2日の予定

*1月実績/2月見込み財政資金対民間収支	*ユーロ圏1月の消費者物価指数速報値
*1月のマネタリーベース	

◆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