

Central Daily Market Report

2022年2月3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3日 需給速報	2022年2月4日 需給予想	2022年2月7日 当社予想
銀行券	▲ 300	500	0
財政	▲ 1,300	▲ 5,000	▲ 3,000
資金過不足	▲ 1,600	▲ 4,500	▲ 3,000
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	12,100		
CP等買入		▲ 100	▲ 300
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 100
新型コロナ対応金融支援特別			
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 200	600	200
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	10,800	▲ 4,700	▲ 3,000
当座預金残高	5,273,600	5,268,900	5,265,900
準備預金残高	4,675,000		
積み終了先	4,675,000		2月4日以降の残り所要積立額
超過準備	4,675,000		積数
非準備預金先	598,600		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
			61.29%

●2022年2月3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▲0.06~▲0.003%での調達で始まった。全体的な出合いの水準は昨日より大きな変化はなく、一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終了した。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、▲0.090~▲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>

3日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、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

2022/2/3	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	0.010	▲ 0.019				-	▲ 0.083	0.175	0.000	27,241.31	▲ 292.29	114.38-39	114.58-59
T/N	▲ 0.013	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.084						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.007	▲ 0.006	▲ 0.007				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.010	0.000	▲ 0.006				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.100	▲ 0.102						
6M							▲ 0.098	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.098	▲ 0.124						
									日付	1/27	1/28	1/31	2/1	2/2
									日銀当預残	5,391,600	5,398,200	5,390,800	5,362,300	5,262,800
									準備預金残	4,776,100	4,782,300	4,775,600	4,747,600	4,671,700
									マネタリーベース	6,633,400	6,639,700	6,631,900	6,602,600	6,502,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.021%	▲ 0.021%	▲ 0.021%	▲ 0.020%	▲ 0.020%
									コール市場残高	200,449	201,684	170,881	199,492	199,843
									うち無担	182,713	184,397	153,825	170,015	170,690
									うちO/N	101,780	105,104	81,872	98,404	97,269
									うち有担	17,736	17,287	17,056	29,477	29,153

●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非価格競争入札(億円)
30年利付国債	73	0.700%	9,000	2022/2/4	2051/12/20	24,939.0	7,235.0	97.8500	0.7880%	90.1222%	97.8600	0.7880%	1,760.0

●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)		2022/2/3	2022/2/4	▲ 0.350	166	166		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/3	2022/2/4	▲ 0.350	0	0				

●2022年2月4日の予定

*米国1月の雇用統計

*国庫短期証券(1056回)入札
(3ヶ月、50,000億円、2/7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