Central Daily Market Report

2022年2月4日（金）
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4日 需給速報		2022年2月7日 需給予想		2022年2月8日 当社予想	
銀行券	500		500		0	
財政	▲ 4,600		2,700		1,000	
資金過不足	▲ 4,100		3,200		1,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
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						
CP等買入		▲ 300		▲ 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						
ＥＴＦ買入			700			
国債補完供給	▲ 100	200		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 4,400		3,700		1,000	

当座預金残高	5,269,200	5,272,900	5,273,900
準備預金残高	4,673,000		
積み終了先	4,673,000	2月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,673,000	積数	100
非準備預金先	596,200	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 100.00%	日数	70.97%

●2022年2月4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▲0.04～▲0.001%での調達で始まった。週末を迎えたがレート水準に大きな変化はみられず、一巡後も朝方と同水準の出合いが数件見られ、今週の取引を終えた。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、▲0.085～▲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>

4日はTB3M物(第1056回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。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

2022/2/4	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.018				－	▲ 0.080
T/N							－	▲ 0.082
S/N							－	－
1W			▲ 0.009				－	▲ 0.083
2W	▲ 0.010	▲ 0.002	▲ 0.005				－	▲ 0.086
3W			0.150				－	▲ 0.088
1M	▲ 0.008	0.150	0.016				－	▲ 0.093
3M							▲ 0.099	▲ 0.102
6M							▲ 0.098	▲ 0.114
1Y							▲ 0.098	▲ 0.124

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.195	0.020	27,439.99	198.68	114.96-97	115.10-11

日付	1/28	1/31	2/1	2/2	2/3
日銀当預残	5,398,200	5,390,800	5,362,300	5,262,800	5,273,600
準備預金残	4,782,300	4,775,600	4,747,600	4,671,700	4,675,000
マネタリーベース	6,639,700	6,631,900	6,602,600	6,502,500	6,513,600
無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.021%	▲0.020%	▲0.020%	▲0.019%
コール市場残高	201,684	170,881	199,492	199,843	203,686
うち無担	184,397	153,825	170,015	170,690	174,671
うちO/N	105,104	81,872	98,404	97,269	99,700
うち有担	17,287	17,056	29,477	29,153	29,015

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1056	－	50,000	2022/2/7	2022/5/16	131,791.5	40,531.6	100.0250	▲0.0930%	1.3166%	100.0260	▲0.0968%	9,468.0

●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）		2022/2/4	2022/2/7	▲ 0.350	66	66		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/2/4	2022/2/7	▲ 0.350	0	0				
社債等買入（残存期間1年以上3年以下）	1,250	2022/2/9			2,033	1,250	0.033		0.042	34.1

●2022年2月7日の予定

*12月の景気動向指数速報
*1月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*米国12月の消費者信用残高

◆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論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