

# Central Daily Market Report

2022年2月7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2月7日 需給速報	2022年2月8日 需給予想	2022年2月9日 当社予想	
銀行券	500	300	0	
財政	▲ 3,400	▲ 1,900	▲ 2,000	
資金過不足	▲ 2,900	▲ 1,600	▲ 2,000	
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				
CP等買入	▲ 300	▲ 100		
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援 社債等買入			1,300	
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	700			
国債補完供給	▲ 100	100	100	
※ドル資金供給用担保提供供給				
当増減	▲ 2,500	▲ 1,600	▲ 700	
当座預金残高	5,266,700	5,265,100	5,264,400	
準備預金残高	4,668,300			
積み終了先	4,668,300	2月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,668,300	積数	100	
非準備預金先	598,400	1日平均	0	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額			3,777,100	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	74.19%

## ●2022年2月7日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落した影響でレートを引き下げる先が見られる一方、堅調な資金調達意欲を示す先も見られたため、全体的には前営業日と横ばい圏内での出会いとなった。立ち上がりは邦銀業態からの調達を中心に▲0.045~▲0.01%の水準で出会いが見られた。一巡後は▲0.06~▲0.02%のレンジの出会いで推移し、本日の取引を終えた。ターム物は1~2Wを中心とするショートタームの引き合いが散見される程度であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.080~▲0.075%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>

7日の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発行市場は閑散で、発行レートは概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/2/7	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.081	0.195	0.000	27,248.87	▲ 191.12	115.22-24	115.25-27
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.003	0.050	0.008				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.013	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.088						
1M	▲ 0.005	0.200	0.098				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.099	▲ 0.102						
6M							▲ 0.098	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.098	▲ 0.124						
									日付	1/31	2/1	2/2	2/3	2/4
									日銀当預残	5,390,800	5,362,300	5,262,800	5,273,600	5,269,200
									準備預金残	4,775,600	4,747,600	4,671,700	4,675,000	4,673,200
									マネタリーベース	6,631,900	6,602,600	6,502,500	6,513,600	6,508,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.021%	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.018%
									コール市場残高	170,881	199,492	199,843	203,686	205,465
									うち無担	153,825	170,015	170,690	174,671	175,764
									うちO/N	81,872	98,404	97,269	99,700	103,093
									うち有担	17,056	29,477	29,153	29,015	29,701

## ●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)		2022/2/7	2022/2/8	▲ 0.350	96	96		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/7	2022/2/8	▲ 0.350	0	0				

## ●2022年2月8日の予定

*12月の全世帯家計調査 市場予想：消費支出、前年比+0.3%	*米国12月の貿易収支	*10年物価連動国債 (2,000億円、2/9発行)
*12月の毎月勤労統計調査速報		*交付税特別会計借入 (11,000億円、2/18借入)
*12月の国際収支		
*12月の特定サービス産業動態統計速報		
*1月の景気ウォッチャー調査		

◆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