

# Central Daily Market Report

2022年2月9日(水)

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9日 需給速報	2022年2月10日 需給予想	2022年2月14日 当社予想			
銀行券	200	100	0			
財政	▲ 400	7,800	▲ 19,000			
資金過不足	▲ 200	7,900	▲ 19,000			
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	5,000					
国債買入		13,200				
CP等買入			▲ 700			
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	▲ 200	100	200			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	6,000	20,600	▲ 19,000			
当座預金残高	5,267,100	5,287,700	5,268,700			
準備預金残高	4,672,800					
積み終了先	4,672,800			2月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,672,800			積数	100	
非準備預金先	594,300			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	80.65%		

## ●2022年2月9日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み期も終盤に近付き調達量を調整する先もみられた事で、出会いレートは昨日と比べやや低下した。立ち上がりは邦銀業態からの調達を中心に▲0.045~▲0.001%の水準で出合いが見られた。一巡後は▲0.06~▲0.01%のレンジの出合いで推移し、本日の取引を終えた。ターム物は概ね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、▲0.085~▲0.075%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>

9日はTB6M物(第1057回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、底堅く推移した。その他、マーケットでは1Y物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、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

2022/2/9	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		
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	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					-	▲ 0.080	0.205	0.000	27,579.87	295.35	115.53-54	115.40-42
T/N			▲ 0.015					-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004					-	▲ 0.082						
2W								-	▲ 0.086						
3W								-	▲ 0.088						
1M	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.009					-	▲ 0.093						
3M								▲ 0.099	▲ 0.102						
6M								▲ 0.094	▲ 0.114						
1Y								▲ 0.094	▲ 0.123						
日付		2/2	2/3	2/4	2/7	2/8									
日銀当預残	5,262,800	5,273,600	5,269,200	5,266,700	5,261,100										
準備預金残	4,671,700	4,675,000	4,673,200	4,668,500	4,668,900										
マネタリーベース	6,502,500	6,513,600	6,508,600	6,505,600	6,499,700										
無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.018%	▲ 0.020%	▲ 0.020%										
コール市場残高	199,843	203,686	205,465	200,695	204,317										
うち無担	170,690	174,671	175,764	171,550	175,373										
うちO/N	97,269	99,700	103,093	102,009	107,242										
うち有担	29,153	29,015	29,701	29,145	28,944										

## ●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)
国庫短期証券	1057	-	34,000	2022/2/10	2022/8/10	97,760.0	27,565.1	100.0430	▲0.0866%	27.7941%	100.0450	▲0.0907%	6,434.0

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/2/10			13,113	4,503	0.002		0.004	40.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/2/10			8,814	4,503	▲0.002		0.000	20.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/2/10			8,345	4,256	▲0.005		▲0.003	51.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/9	2022/2/10	▲ 0.350	153	153		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/9	2022/2/10	▲ 0.350	0	0				

## ●2022年2月10日の予定

*1月の企業物価指数	*米国1月の財政収支	*国庫短期証券(1058回)入札 (3ヶ月、57,000億円、2/14発行)
	*米国1月の消費者物価指数	*流動性供給入札 (5,000億円、2/14発行)
		*エネルギー対策借入 (6,500億円、2/21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