

Central Daily Market Report

2022年2月10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10日 需給速報	2022年2月14日 需給予想	2022年2月15日 当社予想
銀行券	▲ 100	800	0
財政	6,900	▲ 23,400	72,000
資金過不足	6,800	▲ 22,600	72,000
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	13,200		
CP等買入		▲ 700	▲ 600
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	▲ 400	200	400
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	19,100	▲ 22,800	72,000
当座預金残高	5,286,200	5,263,400	5,335,400
準備預金残高	4,695,800		
積み終了先	4,695,700	2月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,695,700	積数	0
非準備預金先	590,400	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
			93.55%

●2022年2月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み期の終盤における四日積みとなり、一部で取り上がる場面が見られたものの、前日比で大きな変化はなかった。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、▲0.080~▲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>

10日はTB3M物(第1058回)の入札が実施された。今回からオファー額が増加(50,000億円→57,000億円)したこともあり、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。

<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。また、本日はCP等買入オペが5,000億円オファーされた。応札額は6,716億円程度とやや少なく、平均レートは▲0.014%・按分レートは▲0.030%と按分が流れる結果となった。

●短期金融市場関連指標

2022/2/10	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	
	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	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.083	0.225	0.020	27,696.08	116.21	115.59-61	115.59-60
T/N							-	▲ 0.082						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.001	0.050	0.016				-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.008				-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.090						
1M			0.130				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.092	▲ 0.102						
6M							▲ 0.094	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.094	▲ 0.123						
									日付	2/3	2/4	2/7	2/8	2/9
									日銀当預残	5,273,600	5,269,200	5,266,700	5,261,100	5,267,100
									準備預金残	4,675,000	4,673,200	4,668,500	4,668,900	4,672,800
									マネタリーベース	6,513,600	6,508,600	6,505,600	6,499,700	6,505,500
									無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.018%	▲0.020%	▲0.020%	▲0.020%
									コール市場残高	203,686	205,465	200,695	204,317	200,790
									うち無担	174,671	175,764	171,550	175,373	171,822
									うちO/N	99,700	103,093	102,009	107,242	103,611
									うち有担	29,015	29,701	29,145	28,944	28,968

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額(億円)	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	1058	-	57,000	2022/2/14	2022/5/23	115,597.0	46,209.6	100.0220	▲0.0819%	4.5460%	100.0244	▲0.0908%	10,790.0
流動性供給	351	-	5,000	2022/2/14		10,056.0	4,998.0		0.0290%	65.1006%		0.0160%	
エネルギー対策	-	-	6,500	2022/2/21	2023/2/20	213,037.0	6,499.92		0.0000%	3.0512%		0.0000%	

●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
CP等買入	5,000	2022/2/16			6,716	4,996	▲0.030		▲0.014	26.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/10	2022/2/14	▲0.350	292	292		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/10	2022/2/14	▲0.350	74	74		▲0.350	▲0.350	

●2022年2月14日の予定

*特にありません。

◆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