

Central Daily Market Report

2022年2月8日(火)

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8日 需給速報	2022年2月9日 需給予想	2022年2月10日 当社予想
銀行券	300	200	▲ 1,000
財政	▲ 5,800	2,500	4,000
資金過不足	▲ 5,500	2,700	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		5,000	
国債買入			
CP等買入	▲ 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	▲ 100	100	100
*ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	▲ 5,600	9,100	3,000
当座預金残高	5,261,100	5,270,200	5,273,200
準備預金残高	4,668,600		
積み終了先	4,668,600		2月9日以降の残り所要積立額
超過準備	4,668,600		積数
非準備預金先	592,500		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
			77.42%

●2022年2月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は前営業日と横ばい圏内での出会いとなった。立ち上がりは邦銀からの調達を中心に▲0.045~▲0.003%の水準で出会いが見られた。一巡後は▲0.065~▲0.01%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>

8日は短国買入オペが前回と同額(5,000億円)オファーされ、甘めの結果となった。マーケット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

2022/2/8	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.020				-	▲ 0.080	0.205	0.010	27,284.52	35.65	115.06-07	115.48-50	
T/N							-	▲ 0.082							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.001				-	▲ 0.083							
2W			0.001				-	▲ 0.086							
3W							-	▲ 0.089							
1M			0.120				-	▲ 0.092							
3M							▲ 0.099	▲ 0.102							
6M							▲ 0.095	▲ 0.114							
1Y							▲ 0.095	▲ 0.123							
									日付		2/1	2/2	2/3	2/4	2/7
									日銀当預残	5,362,300	5,262,800	5,273,600	5,269,200	5,266,700	
									準備預金残	4,747,600	4,671,700	4,675,000	4,673,200	4,668,500	
									マネタリーベース	6,602,600	6,502,500	6,513,600	6,508,600	6,505,600	
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.018%	▲ 0.020%	
									コール市場残高	199,492	199,843	203,686	205,464	200,695	
									うち無担	170,015	170,690	174,671	175,764	171,550	
									うちO/N	98,404	97,269	99,700	103,093	102,009	
									うち有担	29,477	29,153	29,015	29,701	29,145	

●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	棄分率	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)	非競争入札(億円)
物価連動10年	26	0.005%	2,000	2022/2/9	2031/3/10	8,391.0	1,999.0	103.7000	▲0.3880%	48.3443%				
交付税特会	-	-	11,000	2022/2/18	2022/8/19	452,384.0	10,990.02		0.0000%	2.4294%		0.0000%		10.00

●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
国庫短期証券買入	5,000	2022/2/9			16,748	5,000		0.007	0.007	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/2/8	2022/2/9	▲ 0.350	68	68		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/2/8	2022/2/9	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/2/10	2022/2/17	0.340	3	3				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2022/2/9	2022/2/18		2	2		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2022年2月9日の予定

*1月のマネーストック	*米国12月の卸売売上高	*国庫短期証券(1057回)入札(6ヶ月、34,000億円、2/10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