

Central Daily Market Report

2022年1月4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1月4日 需給速報	2022年1月5日 需給予想	2022年1月6日 当社予想
銀行券	2,700	2,900	4,000
財政	▲ 22,500	▲ 5,300	▲ 59,000
資金過不足	▲ 19,800	▲ 2,400	▲ 55,000

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	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			3,800	▲ 5,600				
国債買現								
国債売現								
国庫短期証買入								
国債買入								
CP等買入		▲ 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								
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	700		100				
※ドル資金供給用担保提供供給								
当預増減	▲ 19,500		▲ 4,100		▲ 55,000			

当座預金残高	5,411,000	5,406,900	5,351,900	
準備預金残高	4,806,000			
積み終了先	4,806,000	1月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,806,000	積数	100	
非準備預金先	605,000	1日平均	0	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額			3,769,300	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	64.52%

●2022年1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、国内勢を中心に▲0.06~▲0.005%の調達で始まった。その後も同水準の出合いが継続し本日の取引を終えた。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、▲0.075~▲0.065%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日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2022/1/4	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	▲ 0.016				-	▲ 0.077	0.085	0.015	29,301.79	510.08	115.33-34	115.73-75
T/N	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.020				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.077						
2W	▲ 0.045	0.100	▲ 0.021				-	▲ 0.081						
3W	▲ 0.015	0.150	0.024				-	▲ 0.086						
1M	▲ 0.018	0.200	▲ 0.001				-	▲ 0.089						
3M							▲ 0.160	▲ 0.105						
6M							▲ 0.115	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.129						
									日付	12/24	12/27	12/28	12/29	12/30
									日銀当預残	5,404,300	5,462,700	5,457,100	5,449,100	5,430,500
									準備預金残	4,798,400	4,856,300	4,852,400	4,858,700	4,817,400
									マネタリーベース	6,666,200	6,727,500	6,725,100	6,719,200	6,700,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.023%	▲ 0.021%	▲ 0.018%	▲ 0.016%	▲ 0.018%
									コール市場残高	195,397	182,439	184,682	157,328	125,942
									うち無担	177,732	164,741	166,178	139,532	110,014
									うちO/N	96,759	83,328	85,055	58,954	62,886
									うち有担	17,665	17,698	18,504	17,796	15,928

●入札結果

名称	回数	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	業分率	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
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	20,000	2022/1/5	2022/1/18		3,750	3,750				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/4	2022/1/5	▲ 0.350	108	108		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/4	2022/1/5	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/1/6	2022/1/13	0.330	0	0				

●2022年1月5日の予定

*12月実績/1月見込み財政資金対民間収支	*国庫短期証券(1048回)入札
*12月のマネタリーベース	(3ヶ月、50,000億円、1/6発行)
*12月の消費動向調査	*10年利付国債入札
	(26,000億円、1/6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