

Central Daily Market Report

2022年1月5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1月5日 需給速報	2022年1月6日 需給予想	2022年1月7日 当社予想
銀行券	3,200	1,900	3,000
財政	▲ 4,200	▲ 61,800	3,000
資金過不足	▲ 1,000	▲ 59,900	6,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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		▲ 200	
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			
ETF買入			
国債補充供給	▲ 200	100	200
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	▲ 2,900	▲ 59,900	6,000
当座預金残高	5,408,100	5,348,200	5,354,200
準備預金残高	4,801,200		
積み終了先	4,801,200	1月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,801,200	積数	100
非準備預金先	606,900	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
			67.74%

●2022年1月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日とほぼ同水準の立ち上がりとなった。国内勢を中心に▲0.06~▲0.005%の調達から始まり、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、▲0.07~▲0.055%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>

5日はTB3M物(1048回)の入札が実施され、やや甘めの結果となった。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

2022/1/5	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)
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.072	0.095	0.010	29,332.16	30.37	116.16-18	116.03-04
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.069						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.008	▲ 0.005	▲ 0.007				-	▲ 0.072						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.032				-	▲ 0.077						
3W							-	▲ 0.082						
1M	▲ 0.015	▲ 0.005	▲ 0.009				-	▲ 0.087						
3M							▲ 0.110	▲ 0.105						
6M							▲ 0.115	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.129						
									日付	12/27	12/28	12/29	12/30	1/4
									日銀当預残	5,462,700	5,457,100	5,449,100	5,430,500	5,411,000
									準備預金残	4,856,300	4,852,400	4,858,700	4,817,400	4,806,000
									マネタリーベース	6,727,500	6,725,100	6,719,200	6,700,700	6,678,500
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.018%	▲0.016%	▲0.018%	▲0.016%
									コール市場残高	182,439	184,682	157,328	125,942	149,485
									うち無担	164,741	166,178	139,532	110,014	132,664
									うちO/N	83,328	85,055	58,954	62,886	68,936
									うち有担	17,698	18,504	17,796	15,928	16,821

●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非償還額争入札(億円)	非償還額争入札(億円)
国庫短期証券	1048	-	50,000	2022/1/6	2022/4/4	126,567.0	40,666.6	100.0260	▲0.1078%	26.3636%	100.0285	▲0.1181%	9,333	
10年利付国債	365	0.10%	26,000	2022/1/6	2031/12/20	72,541.0	20,978.00	100.0200	0.0970%	38.3637%	100.0300	0.0960%	4,999.0	13.67

●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	申込総額(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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/5	2022/1/6	▲ 0.350	200	200		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/5	2022/1/6	▲ 0.350	0	0				

●2022年1月6日の予定

*1月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国11月の貿易収支 *米国11月の製造業新規受注・出荷・在庫 *米国12月のISM非製造業景況指数	*国庫短期証券(1049回)入札 (6ヶ月、34,500億円、1/11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