

# Central Daily Market Report

2022年1月6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1月6日 需給速報	2022年1月7日 需給予想	2022年1月11日 当社予想
銀行券	2,100	3,100	3,000
財政	▲ 62,800	▲ 4,100	▲ 10,000
資金過不足	▲ 60,700	▲ 1,000	▲ 7,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現		20,600	
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		10,600	
CP等買入	▲ 200	▲ 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	200	200
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 60,900	30,100	▲ 7,000
当座預金残高	5,347,200	5,377,300	5,370,300
準備預金残高	4,768,000		
積み終了先	4,768,000	1月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,768,000	積数	100
非準備預金先	579,200	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
			70.97%

## ●2022年1月6日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.05~▲0.003%の調達で始まった。一巡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の出合いが散見される程度であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.06%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>

6日はTB6M物(1049回)の入札が実施され、やや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。この他、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

2022/1/6	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	
	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)
単位: %									0.115	0.020	28,487.87	▲ 844.29	116.12-13	115.87-89
O/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.064						
T/N	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.005				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.009	▲ 0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.076						
2W	▲ 0.015	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.078						
3W							-	▲ 0.082						
1M			0.150				-	▲ 0.088						
3M							▲ 0.110	▲ 0.105						
6M							▲ 0.103	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.129						
									日付	12/28	12/29	12/30	1/4	1/5
									日銀当預残	5,457,100	5,449,100	5,430,500	5,411,000	5,408,100
									準備預金残	4,852,400	4,858,700	4,817,400	4,806,000	4,801,400
									マネタリーベース	6,725,100	6,719,200	6,700,700	6,678,500	6,672,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.016%	▲ 0.018%	▲ 0.016%	▲ 0.012%
									コール市場残高	184,682	157,328	125,942	149,485	167,279
									うち無担	166,178	139,532	110,014	132,664	149,606
									うちO/N	85,055	58,954	62,886	68,936	79,293
									うち有担	18,504	17,796	15,928	16,821	17,673

## ●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	1049	-	34,500	2022/1/11	2022/7/11	104,778.0	28,068.4	100.0490	▲0.0987%	2.0426%	100.0530	▲0.1068%	6,431.0

## ●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)	発札総額(億円・百万ドル)	競分レート・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	競分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/1/7			10,846	4,505	0.003		0.004	57.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/1/7			14,761	4,503	0.008		0.012	46.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2022/1/7			4,797	1,505	0.012		0.013	92.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/6	2022/1/7	▲ 0.350	217	217		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/6	2022/1/7	▲ 0.350	0	0				
国債買現先	20,000	2022/1/7	2022/1/14		45,818	20,005	▲ 0.100		▲ 0.095	26.3

## ●2022年1月7日の予定

*11月の全世帯家計調査 市場予想:消費支出・前年比+1.6%	*米国12月の雇用統計 *米国11月の消費者信用残高 *ユーロ圏12月の消費者物価指数速報値	*国庫短期証券(1050回)入札 (3ヶ月、50,000億円、1/11発行) *30年利付国債入札 (9,000億円、1/11発行) *交付税特別会計借入 (11,000億円、1/18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