

Central Daily Market Report

2022年1月11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11日 需給速報	2022年1月12日 需給予想	2022年1月13日 当社予想	
銀行券	2,600	2,400	2,000	
財政	▲12,200	500	▲37,000	
資金過不足	▲9,600	2,900	▲35,000	
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		10,300		
CP等買入	▲200	▲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				
ETF買入				
国債補完供給	▲400	200	400	
※ドル資金供給用担保国債供給				
当預増減	▲10,000	13,500	▲33,700	
当座預金残高	5,369,400	5,382,900	5,349,200	
準備預金残高	4,782,700			
積み終了先	4,782,700	1月12日以降の残り所要積立額	0	
超過準備	4,782,700	積数	0	
非準備預金先	586,700	1日平均	0	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額			3,767,400	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	87.10%

●2022年1月11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▲0.030~▲0.003%の調達で始まった。積み期終盤にあたることから、一部調達水準を引き下げる動きも見られたものの、ビッドサイドの調達意欲は概ね堅調であった。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、▲0.09~▲0.08%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>

11日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物が引け際に少額出合いが見られた。

<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

2022/1/11	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲0.087	0.001	▲0.014					-	▲0.082	0.150	0.020	28,222.48	▲256.08	115.27-29	115.25-27
T/N								-	▲0.087						
S/N			▲0.005					-	-						
1W	▲0.045	0.002	▲0.029					-	▲0.088						
2W	▲0.040	0.050	▲0.022					-	▲0.088						
3W								-	▲0.090						
1M			▲0.007					-	▲0.094						
3M								▲0.103	▲0.103						
6M								▲0.103	▲0.119						
1Y								▲0.119	▲0.129						
										日付	12/30	1/4	1/5	1/6	1/7
										日銀当預残	5,430,500	5,411,000	5,408,100	5,347,200	5,379,400
										準備預金残	4,817,400	4,806,000	4,801,400	4,768,000	4,774,400
										マネタリーベース	6,700,700	6,678,500	6,672,500	6,609,500	6,638,600
										無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.009%	▲0.008%
										コール市場残高	125,942	149,485	167,279	179,841	187,228
										うち無担	110,014	132,664	149,606	162,051	169,981
										うちO/N	62,886	68,936	79,293	87,848	95,543
										うち有担	15,928	16,821	17,673	17,790	17,247

●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	案分率	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	買付利率	応札総額 (億円・百万ドル)	発札総額 (億円・百万ドル)	抜付レート ・利回差 ・価格差	全取レート ・利回差 ・価格差	平均発札レート ・利回差 ・価格差	抜付比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2022/1/12			2,373	1,500	▲0.009		▲0.001	93.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/1/12			9,693	4,506	0.001		0.002	39.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/1/12			9,124	4,260	0.004		0.005	79.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/11	2022/1/12	▲0.350	378	378		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/11	2022/1/12	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/1/13	2022/1/20	0.330	1	1				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2022/1/12	2022/1/21		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2022年1月12日の予定

*11月の国際収支	*米国米ページブック	*5年利付国債入札 (25,000億円、1/13発行)
*12月の景気ウォッチャー調査	*米国12月の財政収支	*エネルギー対策借入 (6,500億円、1/20借入)
	*米国12月の消費者物価指数	

◆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