

# Central Daily Market Report

2022年1月12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12日 需給速報	2022年1月13日 需給予想	2022年1月14日 当社予想			
銀行券	2,500	1,900	2,000			
財政	0	▲ 31,800	3,000			
資金過不足	2,500	▲ 29,900	5,000			
<b>金融調節</b>	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						
国債買現						▲ 20,600
国債売現						
国庫短期証買入			5,000			
国債買入	10,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 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	▲ 400	400		400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	12,700	▲ 23,300		▲ 15,600		
当座預金残高	5,382,100	5,358,800		5,343,200		
準備預金残高	4,773,500					
積み終了先	4,773,400			1月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,773,400			積数		0
非準備預金先	608,600			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		90.32%

## ●2022年1月12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▲0.035~▲0.003%の調達で始まった。一巡後は調整の出会いが散見される程度で本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの出会いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲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>

12日は短国買入オペが5,000億円オファーされ、やや弱めの結果となった。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

2022/1/12	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.084	0.125	▲ 0.025	28,765.66	543.18	115.33-35	115.39-41
T/N							-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.006				-	▲ 0.087						
2W			▲ 0.050				-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.010	0.150	0.007				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.103	▲ 0.103						
6M							▲ 0.103	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.129						
									日付	1/4	1/5	1/6	1/7	1/11
									日銀当預残	5,411,000	5,408,100	5,347,200	5,379,400	5,369,400
									準備預金残	4,806,000	4,801,400	4,768,000	4,774,400	4,783,400
									マネタリーベース	6,678,500	6,672,500	6,609,500	6,638,600	6,626,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.016%	▲ 0.012%	▲ 0.009%	▲ 0.008%	▲ 0.014%
									コール市場残高	149,485	167,279	179,841	187,228	172,179
									うち無担	132,664	149,606	162,051	169,981	155,257
									うちO/N	68,936	79,293	87,848	95,543	85,054
									うち有担	16,821	17,673	17,790	17,247	16,922

## ●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)
5年利付国債	150	0.005%	25,000	2022/1/13	2026/12/20	67,577.0	20,257.0	100.2100	▲0.0370%	73.6701%	100.2300	▲0.0410%	4,739.0
エネルギー対策	-	-	6,500	2022/1/20	2023/1/20	222,651.0	6,499.68		0.0000%	2.9193%		0.0000%	

## ●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	2022/1/13			20,764	5,001	0.007		0.009	2.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/12	2022/1/13	▲ 0.350	374	374		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/12	2022/1/13	▲ 0.350	0	0				

## ●2022年1月13日の予定

\*11月の特定サービス産業動態統計速報  
\*12月のマネーストック

\*米国12月の生産者物価指数

◆本資料は信頼できるとさ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