Central Daily Market Report

2022年1月13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13日 需給速報		2022年1月14日 需給予想		2022年1月17日 当社予想	
銀行券	2,000		2,600		2,000	
財政	▲ 32,400		7,000		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 30,400		9,600		▲ 7,000	
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
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 900		
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	▲ 300	400		300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 24,100		▲ 11,600		▲ 7,000	

当座預金残高	5,358,000	5,346,400	5,339,400
準備預金残高	4,776,800		
積み終了先	4,776,800		
超過準備	4,776,800		
非準備預金先	581,200		

1月14日以降の残り所要積立額	
積数	0
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 93.55%

●2022年1月13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▲0.045～▲0.005%の調達で始まった。一巡後は調整の出合い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合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085～▲0.075%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>

13日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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

2022/1/13	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.021				－	▲ 0.082
T/N			▲ 0.001				－	▲ 0.087
S/N			▲ 0.005				－	－
1W			▲ 0.016				－	▲ 0.087
2W	▲ 0.060	▲ 0.001	▲ 0.042				－	▲ 0.089
3W							－	▲ 0.090
1M	▲ 0.040	0.010	▲ 0.020				－	▲ 0.095
3M							▲ 0.103	▲ 0.103
6M							▲ 0.103	▲ 0.118
1Y							▲ 0.115	▲ 0.129

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.125	0.000	28,489.13	▲ 276.53	114.67-68	114.40-42

日付	1/5	1/6	1/7	1/11	1/12
日銀当預残	5,408,100	5,347,200	5,379,400	5,369,400	5,382,100
準備預金残	4,801,400	4,768,000	4,774,400	4,783,400	4,773,800
マネタリーベース	6,672,500	6,609,500	6,638,600	6,626,000	6,636,200
無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.014%	▲0.021%
コール市場残高	167,279	179,841	187,228	172,179	185,381
うち無担	149,606	162,051	169,981	155,257	168,520
うちO/N	79,293	87,848	95,543	85,054	98,787
うち有担	17,673	17,790	17,247	16,922	16,861

●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Ｉ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/1/13	2022/1/14	▲ 0.350	300	300		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/1/13	2022/1/14	▲ 0.350	0	0				

●2022年1月14日の予定

*12月の企業物価指数

*米国11月の企業在庫
*米国12月の小売売上高
*米国12月の鉱工業生産・設備稼働率
*米国1月のミシガン大消費者信頼感指数速報

*国庫短期証券（1051回）入札
（3ヶ月、50,000億円、1/17発行）
*20年利付国債入札
（12,000億円、1/17発行）
*交付税特別会計借入
（11,000億円、1/26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。
◆本資料は何ら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論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