Central Daily Market Report

2022年1月14日（金）
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14日 需給速報		2022年1月17日 需給予想		2022年1月18日 当社予想	
銀行券	2,500		1,800		1,000	
財政	10,000		▲ 23,900		3,000	
資金過不足	12,500		▲ 22,100		4,000	
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						▲ 3,800
国債買現		▲ 20,600				
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 900		▲ 500		
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						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 8,900		▲ 22,400		200	

当座預金残高	5,349,100	5,326,700	5,326,900
準備預金残高	4,763,400		
積み終了先	4,763,400	1月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,763,400	積数	404,300
非準備預金先	585,700	1日平均	13,500
積み期間（1/16～2/15）の所要準備額			3,779,800
準備預金進捗率	実績 89.30%	日数	3.23%

●2022年1月14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▲0.050～▲0.005%の調達で始まった。積み最終日にあたるものの大幅なレート変動は見られず、一巡後は調整の出合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合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085～▲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>

14日はTB3M物(第1051回)の入札が実施され、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、入札結果と同水準で推移した。

<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。また、CP等買入オペが5,000億円オファーされた。

●短期金融市場関連指標

2022/1/14	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.020				－	▲ 0.084
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.085
S/N			▲ 0.005				－	－
1W	▲ 0.019	▲ 0.003	▲ 0.013				－	▲ 0.086
2W	▲ 0.060	0.005	▲ 0.034				－	▲ 0.088
3W							－	▲ 0.089
1M			▲ 0.003				－	▲ 0.094
3M			0.010				▲ 0.095	▲ 0.102
6M							▲ 0.103	▲ 0.117
1Y							▲ 0.115	▲ 0.128

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）
0.145	0.020	28,124.28	▲ 364.85	114.11-12	113.79-80

日付	1/6	1/7	1/11	1/12	1/13
日銀当預残	5,347,200	5,379,400	5,369,400	5,382,100	5,358,000
準備預金残	4,768,000	4,774,400	4,783,400	4,773,800	4,776,800
マネタリーベース	6,609,500	6,638,600	6,626,000	6,636,200	6,610,000
無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.008%	▲0.014%	▲0.021%	▲0.021%
コール市場残高	179,841	187,228	172,179	185,381	193,823
うち無担	162,051	169,981	155,257	168,520	175,527
うちO/N	87,848	95,543	85,054	98,787	107,004
うち有担	17,790	17,247	16,922	16,861	18,296

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1051	－	50,000	2022/1/17	2022/4/18	120,238.5	40,662.6	100.0230	▲0.0922%	40.8089%	100.0242	▲0.0970%	9,337	
20年利付国債	179	0.500%	12,000	2022/1/17	2041/12/20	31,020.0	9,758.0	99.3500	0.5360%	94.8003%	99.4100	0.5320%	2,232	
交付税特会	－	－	11,000	2022/1/26	2022/7/27	474,601.0	10,990.03		0.0000%	2.3157%		0.0000%		10.00

●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
CP等買入	5,000	2022/1/19			8,320	4,995	▲0.012		▲0.010	67.5
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/1/14	2022/1/17	▲ 0.350	153	153		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/1/14	2022/1/17	▲ 0.350	0	0				

●2022年1月17日の予定

*日銀政策委員会・金融政策決定会合（1日目）
*11月の機械受注統計（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比＋1.4%）
*11月の第3次産業活動指数
*New York祝日
(Martin L.King Jr.'s Day)

◆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