

# Central Daily Market Report

2022年1月18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18日 需給速報	2022年1月19日 需給予想	2022年1月20日 当社予想
銀行券	2,000	1,700	0
財政	15,100	800	▲ 25,000
資金過不足	17,100	2,500	▲ 25,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	3,000	▲ 3,800	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	13,800		
CP等買入		▲ 100	5,000 ▲ 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			
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	100	200
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	29,900	7,600	▲ 25,000

当座預金残高	5,355,400	5,363,000	5,338,000
準備預金残高	4,745,100		
積み終了先	4,743,700	1月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,736,700	積数	7,300
非準備預金先	610,300	1日平均	300
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	99.81%	日数
			9.68%

## ●短期金融市場関連指標

2022/1/18	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		
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.086	0.145	0.005	28,257.25	▲ 76.27	114.56-58	114.86-88	
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086							
S/N			▲ 0.005				-	-							
1W	▲ 0.013	▲ 0.010	▲ 0.013				-	▲ 0.085							
2W	▲ 0.050	▲ 0.003	▲ 0.031				-	▲ 0.087							
3W							-	▲ 0.088							
1M	▲ 0.010	0.011	0.007				-	▲ 0.093							
3M							▲ 0.095	▲ 0.102							
6M							▲ 0.103	▲ 0.117							
1Y							▲ 0.115	▲ 0.128							
									日付		1/11	1/12	1/13	1/14	1/17
									日銀当預残	5,369,400	5,382,100	5,358,000	5,349,100	5,325,500	
									準備預金残	4,783,400	4,773,800	4,776,800	4,762,800	4,718,500	
									マネタリーベース	6,626,000	6,636,200	6,610,000	6,598,700	6,573,200	
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.021%	▲ 0.021%	▲ 0.020%	▲ 0.029%	
									コール市場残高	172,179	185,381	193,823	166,843	187,487	
									うち無担	155,257	168,520	175,527	147,946	170,003	
									うちO/N	85,054	98,787	107,004	82,393	103,465	
									うち有担	16,922	16,861	18,296	18,897	17,484	

## ●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)		2022/1/18	2022/1/19	▲ 0.350	158	158		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/18	2022/1/19	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/1/20	2022/1/27	0.330	0	0				

## ●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

- 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定。
  - 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)  
次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。  
短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。  
長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
  - 資産買入れ方針(全員一致)  
長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。  
①ETFおよびJ-REITについては、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ベースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。  
②CP等、社債等については、2022年3月末までの間、合計で約20兆円の残高を上限に、買入れを行う。
- 日本銀行は、「貸出増加を支援するための資金供給」について、貸付実行期限を1年間延長することを決定した(全員一致)。
- 日本銀行は、2%の「物価安定の目標」の実現を目指し、これを安定的に持続するために必要な時点まで、「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続する。マネタリーベースについては、消費者物価指数(除く生鮮食品)の前年比上昇率の実績値が安定的に2%を超えるまで、拡大方針を継続する。引き続き、①新型コロナ対応資金繰り支援特別プログラム、②国債買入れやドルオペなどによる円貨および外貨の上限を設けない潤沢な供給、③それぞれ約12兆円および約1,800億円の年間増加ベースの上限のもとでのETFおよびJ-REITの買入れにより、企業等の資金繰り支援と金融市場の安定維持に努めていく。当面、新型コロナウイルス感染症の影響を注視し、必要があれば、躊躇なく追加的な金融緩和措置を講じる。政策金利については、現在の長短金利の水準、または、それを下回る水準で推移することを想定している。

◆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

## ●2022年1月18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▲0.07~▲0.01%の調達で始まった。積み期序盤ではあるが、地銀を中心に調達ニーズが強い地合いが続いている。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>

18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市場は、複数の発行体から入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●入札結果

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。

## ●2022年1月19日の予定

\*11月の石油等消費動態統計  
\*米国12月の住宅着工件数 \*英国12月の消費者物価指数  
\*国庫短期証券(1052回)入札(1年、35,000億円、1/20発行)  
\*流動性供給入札(4,000億円、1/20発行)  
\*交付税特別会計借入(11,000億円、1/28借入)