

# Central Daily Market Report

2022年1月20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20日 需給速報	2022年1月21日 需給予想	2022年1月24日 当社予想
銀行券	700	800	1,000
財政	▲ 26,900	5,800	3,000
資金過不足	▲ 26,200	6,600	4,000
<b>金融調節</b>			
	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		13,600	
CP等買入	▲ 400	▲ 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		▲ 100	
新型コロナ対応金融支援特別			
気候変動対応オペ			
E T F 買入		300	
国債補完供給	▲ 300	200	300
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 26,700	20,600	4,000
当座預金残高	5,336,700	5,357,300	5,361,300
準備預金残高	4,710,000		
積み終了先	4,709,500	1月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,709,100	積数	5,100
非準備預金先	626,700	1日平均	200
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	99.87%	日数
			16.13%

## ●2022年1月20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▲0.065~▲0.01%の調達で始まった。レートは前日比で概ね横ばいの推移となった。引き続き、地銀を中心に調達ニーズが強い地合いであった。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>

20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

2022/1/20	無担(速報)			有担(速報)			短国	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	売買参考値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.086	0.140	0.006	27,772.93	305.70	114.34-36	114.39-40
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.012	▲ 0.008	▲ 0.011				-	▲ 0.087						
2W			0.050				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.013	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.095	▲ 0.102						
6M							▲ 0.100	▲ 0.116						
1Y							▲ 0.099	▲ 0.126						
									日付	1/13	1/14	1/17	1/18	1/19
									日銀当預残	5,358,000	5,349,100	5,325,500	5,355,400	5,363,400
									準備預金残	4,776,800	4,762,800	4,718,500	4,745,400	4,745,700
									マネタリーベース	6,610,000	6,598,700	6,573,200	6,601,000	6,607,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.021%	▲ 0.020%	▲ 0.029%	▲ 0.028%	▲ 0.026%
									コール市場残高	193,823	166,843	187,487	190,486	187,904
									うち無担	175,527	147,946	170,003	173,166	170,660
									うちO/N	107,004	82,393	103,465	102,723	100,407
									うち有担	18,296	18,897	17,484	17,320	17,244

## ●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	棄分率	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	貸付利率	応札総額(億円・百万ドル)	発札総額(億円・百万ドル)	貸付レート・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	貸付比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2022/1/21			7,255	4,505	0.001		0.003	68.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/1/21			12,657	4,507	0.001		0.002	15.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/1/21			8,804	4,265	0.001		0.002	57.9
国債買入(変動利付債)	300	2022/1/21			897	300	▲ 1.250		▲ 1.318	57.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/20	2022/1/21	▲ 0.350	258	258		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/20	2022/1/21	▲ 0.350	0	0				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2022/1/25			1,811	750	0.178		0.189	81.4

## ●2022年1月21日の予定

*12月の全国消費者物価指数(GPI) 市場予想: 前年同月比(除く生鮮)+0.6%	*国庫短期証券(1053回)入札(3ヶ月、50,000億円、1/24発行)
*金融政策決定会合議事要旨(12月16・17日分)	*流動性供給入札(5,000億円、1/24発行)
	*交付税特別会計借入(11,000億円、2/1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