

Central Daily Market Report

2022年1月24日(月)
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24日 需給速報	2022年1月25日 需給予想	2022年1月26日 当社予想
銀行券	500	700	1,000
財政	▲ 1,500	23,600	▲ 4,000
資金過不足	▲ 1,000	24,300	▲ 3,000
金融調節	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			
CP等買入	▲ 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	▲ 200	800	▲ 100
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	▲ 100		100
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 1,400	25,100	▲ 3,000
当座預金残高	5,352,100	5,377,200	5,374,200
準備預金残高	4,725,400		
積み終了先	4,725,000		1月25日以降の残り所要積立額
超過準備	4,725,000		積数
非準備預金先	626,700		1日平均
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	99.92%	日数
			29.03%

●2022年1月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.06~▲0.008%での調達で始まった。一巡後も朝方と同水準のレートでの出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物に関しては、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.080%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>

24日はTB6M物(第1054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、やや堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、複数の業態から入札が実施された。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/1/24	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		
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.021					-	▲ 0.086	0.135	0.005	27,588.37	66.11	113.78-80	113.75-77
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.013	▲ 0.005	▲ 0.011					-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.010	0.050	0.007					-	▲ 0.089						
3W								-	▲ 0.089						
1M			▲ 0.012					-	▲ 0.094						
3M								▲ 0.096	▲ 0.102						
6M								▲ 0.098	▲ 0.115						
1Y								▲ 0.099	▲ 0.125						
										日付	1/17	1/18	1/19	1/20	1/21
										日銀当預残	5,325,500	5,355,400	5,363,400	5,336,700	5,353,500
										準備預金残	4,718,500	4,745,400	4,745,700	4,710,100	4,725,200
										マネタリーベース	6,573,200	6,601,000	6,607,500	6,580,100	6,596,100
										無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.028%	▲ 0.026%	▲ 0.025%	▲ 0.020%
										コール市場残高	187,487	190,486	187,904	193,896	199,668
										うち無担	170,003	173,166	170,660	177,040	182,040
										うちO/N	103,465	102,723	100,407	105,427	112,377
										うち有担	17,484	17,320	17,244	16,856	17,628

●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)
国庫短期証券	1054	-	34,500	2022/1/25	2022/7/25	124,331.0	28,154.5	100.0430	▲0.0866%	28.7513%	100.0450	▲0.0907%	6,345.0

●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)		2022/1/24	2022/1/25	▲ 0.350	87	87		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/24	2022/1/25	▲ 0.350	0	0				

●2022年1月25日の予定

*米国FOMC(1日目)	*40年利付国債入札
*米国11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	(6,000億円、1/26発行)

◆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お客様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