

Central Daily Market Report

2022年1月26日(水)
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26日 需給速報	2022年1月27日 需給予想	2022年1月28日 当社予想
銀行券	200	▲ 600	▲ 1,000
財政	▲ 5,900	9,900	8,000
資金過不足	▲ 5,700	9,300	7,000
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		5,000	
国債買入		9,500	
CP等買入	▲ 300	▲ 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	100
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	▲ 6,100	23,800	7,000
当座預金残高	5,370,400	5,394,200	5,401,200
準備預金残高	4,748,500		
積み終了先	4,748,200	1月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,748,200	積数	2,500
非準備預金先	621,900	1日平均	100
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	99.93%	日数
			35.48%

●2022年1月26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。前日比でレート水準に大きな変化はなく、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~▲0.075%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>

26日は短国買入オペが前回と同額(5,000億円)で実施され、やや弱めの結果となった。マーケット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、複数の業態から大型発行が見られ、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。また、CP等買入オペが5,000億円オファーされ、按分落札レート▲0.013%、平均落札レート▲0.011%の結果となった。

●短期金融市場関連指標

2022/1/26	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.085	0.135	0.000	27,011.33	▲ 120.01	113.89-90	113.97-99
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.081						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.012	▲ 0.014				-	▲ 0.082						
2W	▲ 0.013	▲ 0.012	▲ 0.013				-	▲ 0.083						
3W							-	▲ 0.087						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.093						
3M							▲ 0.096	▲ 0.101						
6M							▲ 0.098	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.099	▲ 0.124						
									日付	1/19	1/20	1/21	1/24	1/25
									日銀当預残	5,363,400	5,336,700	5,353,500	5,352,100	5,376,500
									準備預金残	4,745,700	4,710,100	4,725,200	4,725,500	4,754,600
									マネタリーベース	6,607,500	6,580,100	6,596,100	6,594,200	6,617,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.026%	▲ 0.025%	▲ 0.020%	▲ 0.021%	▲ 0.021%
									コール市場残高	187,904	193,896	199,668	188,549	200,260
									うち無担	170,660	177,040	182,040	171,246	182,682
									うちO/N	100,407	105,427	112,377	102,553	101,849
									うち有担	17,244	16,856	17,628	17,303	17,578

●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非償価格募入札(億円)	非償募入札(億円)
交付税特会	-	-	11,000	2022/2/4	2022/8/5	452,923.0	10,990.34		0.0000%	2.4266%		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
国庫短期証券買入	5,000	2022/1/27			25,945	5,001	0.006		0.006	92.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2022/1/27			10,950	4,505	0.002		0.003	20.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2022/1/27			9,263	4,262	0.003		0.003	77.6
国債買入(物価連動債)	600	2022/1/27			2,969	600		▲ 0.430	▲ 0.435	
CP等買入	5,000	2022/1/31			7,133	4,992	▲ 0.013		▲ 0.011	20.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/1/26	2022/1/27	▲ 0.350	85	85		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/26	2022/1/27	▲ 0.350	0	0				

●2022年1月27日の予定

*米国10-12月期のGDP速報値	*2年利付国債入札
*米国12月の耐久財新規受注	(30,000億円、2/1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