

# Central Daily Market Report

2022年1月27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27日 需給速報	2022年1月28日 需給予想	2022年1月31日 当社予想			
銀行券	▲ 600	300	1,400			
財政	7,500	9,100	8,400			
資金過不足	6,900	9,400	9,800			
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						
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		▲ 100	▲ 700	5,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
新型コロナウイルス対応金融支援特別 気候変動対応オペ						▲ 132,200
E T F 買入			300			
国債補完供給	▲ 200	100	200			
*ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	21,200	9,200	▲ 117,400			
当座預金残高	5,391,600	5,400,800	5,283,400			
準備預金残高	4,776,100					
積み終了先	4,775,700			1月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,775,700			積数	2,100	
非準備預金先	615,500			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	99.94%	日数	38.71%		

## ●2022年1月27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。引き続き調達ニーズは強く、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、▲0.090~▲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>

27日のアウトライ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発行市場は月末発行にあたり、幅広い業態がまとまった発行を実施した。発行レートに目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/1/27	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.087	0.155	0.020	26,170.30	▲ 841.03	114.72-73	114.77-78
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.003	▲ 0.012				-	▲ 0.086						
2W							-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.008	0.230	0.013				-	▲ 0.094						
3M								▲ 0.095						
6M								▲ 0.098						
1Y								▲ 0.099						
									日付	1/20	1/21	1/24	1/25	1/26
									日銀当預残	5,336,700	5,353,500	5,352,100	5,376,500	5,370,400
									準備預金残	4,710,100	4,725,200	4,725,500	4,754,600	4,748,500
									マネタリーベース	6,580,100	6,596,100	6,594,200	6,617,900	6,611,600
									無担O/N加重平均	▲0.025%	▲0.020%	▲0.021%	▲0.021%	▲0.021%
									コール市場残高	193,896	199,668	188,549	200,260	193,926
									うち無担	177,040	182,040	171,246	182,682	176,460
									うちO/N	105,427	112,377	102,553	101,849	95,837
									うち有担	16,856	17,628	17,303	17,578	17,466

## ●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)
2年利付国債	433	0.005%	30,000	2022/2/1	2024/2/1	94,512.0	24,394.0	100.1100	▲0.0490%	11.3799%	100.1190	▲0.0540%	5,596.0

## ●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)		2022/1/27	2022/1/28	▲0.350	204	204		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/27	2022/1/28	▲0.350	0	0				

## ●2022年1月28日の予定

*1月の都区部消費者物価指数 市場予想: 前年同月比(除く生鮮)+0.3%	*米国12月の個人所得・消費支出	*国庫短期証券(1055回)入札 (3ヶ月、50,000億円、1/31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