Central Daily Market Report

2022年1月25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25日 需給速報		2022年1月26日 需給予想		2022年1月27日 当社予想	
銀行券	700		300		0	
財政	23,000		▲ 500		2,000	
資金過不足	23,700		▲ 200		2,000	
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						
国債買入						
CP等買入				▲ 300		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入	800	▲ 100		▲ 100		
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	▲ 100	100		100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	24,400		▲ 500		2,000	

当座預金残高	5,376,500	5,376,000	5,378,000
準備預金残高	4,753,500		
積み終了先	4,753,200	1月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,753,200	積数	2,900
非準備預金先	623,000	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 99.92%	日数	32.26%

●2022年1月25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、▲0.085～▲0.070%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>
25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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/1/25	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.021				－	▲ 0.088
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.082
S/N			▲ 0.005				－	－
1W			▲ 0.010				－	▲ 0.083
2W			▲ 0.012				－	▲ 0.086
3W							－	▲ 0.089
1M							－	▲ 0.092
3M							▲ 0.096	▲ 0.101
6M							▲ 0.098	▲ 0.114
1Y							▲ 0.099	▲ 0.125

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.135	0.000	27,131.34	▲ 457.03	114.00-02	113.88-89

日付	1/18	1/19	1/20	1/21	1/24
日銀当預残	5,355,400	5,363,400	5,336,700	5,353,500	5,352,100
準備預金残	4,745,400	4,745,700	4,710,100	4,725,200	4,725,500
マネタリーベース	6,601,000	6,607,500	6,580,100	6,596,100	6,594,200
無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.026%	▲0.025%	▲0.020%	▲0.021%
コール市場残高	190,486	187,904	193,896	199,668	188,549
うち無担	173,166	170,660	177,040	182,040	171,246
うちO/N	102,723	100,407	105,427	112,377	102,553
うち有担	17,320	17,244	16,856	17,628	17,303

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
40年利付国債	14	0.700%	6,000	2022/1/26	2061/3/20	15,416.0	5,988.00	97.9700	0.7600%	39.9532%			

●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）		2022/1/25	2022/1/26	▲ 0.350	69	69		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/1/25	2022/1/26	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/1/27	2022/2/3	0.340	1	1				

●2022年1月26日の予定

*決定会合における主な意見（1月17、18日分）
*11月の景気動向指数改訂状況
*12月の企業向けサービス価格指数
*米国FOMC(2日目)
*米国12月の新築一戸建て販売件数
*交付税特別会計借入（11,000億円、2/4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。
◆本資料は何ら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論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