

# Central Daily Market Report

2022年1月28日(金)  
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28日 需給速報	2022年1月31日 需給予想	2022年2月1日 当社予想
銀行券	300	500	1,000
財政	6,800	6,100	▲ 30,000
資金過不足	7,100	6,600	▲ 29,000
<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			
CP等買入		▲ 700	5,000 ▲ 4,000
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			123,500 ▲ 132,200
気候変動対応オペ			
E T F 買入	300		
国債補完供給	▲ 200	100	300
*ドル資金供給用担保提供			
当預増減	6,600	▲ 800	▲ 29,000
当座預金残高	5,398,200	5,397,400	5,368,400
準備預金残高	4,782,000		
積み終了先	4,781,600		1月31日以降の残り所要積立額
超過準備	4,781,600		積数 1,100
非準備預金先	616,200		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	99.97%	日数 48.39%

## ●2022年1月28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。週末3日積みの取引となったが、レート水準に大きな変化は見られず、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、今週の取引を終えた。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>

28日はTB3M物(第1055回)の入札が実施され、無難な結果となった。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発行市場は月初発行にあたり、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。発行レートは横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/1/28	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.087	0.165	0.010	26,717.34	547.04	115.34-36	115.64-66
T/N	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.006	▲ 0.012				-	▲ 0.086						
2W	▲ 0.015	0.001	▲ 0.005				-	▲ 0.087						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.015	0.001	▲ 0.006				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.099	▲ 0.102						
6M							▲ 0.098	▲ 0.114						
1Y							▲ 0.098	▲ 0.124						
									日付	1/21	1/24	1/25	1/26	1/27
									日銀当預残	5,353,500	5,352,100	5,376,500	5,370,400	5,391,600
									準備預金残	4,725,200	4,725,500	4,754,600	4,748,500	4,776,100
									マネタリーベース	6,596,100	6,594,200	6,617,900	6,611,600	6,633,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.021%	▲ 0.021%	▲ 0.021%	▲ 0.021%
									コール市場残高	199,668	188,549	200,260	193,926	200,449
									うち無担	182,040	171,246	182,682	176,460	182,713
									うちO/N	112,377	102,553	101,849	95,837	101,780
									うち有担	17,628	17,303	17,578	17,466	17,736

## ●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	1055	-	50,000	2022/1/31	2022/5/9	152,703.0	40,667.7	100.0240	▲0.0893%	16.1165%	100.0248	▲0.0923%	9,332.0

## ●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)		2022/1/28	2022/1/31	▲ 0.350	185	185		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/1/28	2022/1/31	▲ 0.350	16	16		▲ 0.350	▲ 0.350	
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考) 2022/1/31時点の貸出残高(億円)					
新型コロナウイルス対応金融支援特別	2022/1/31	2022/7/29	0	123,525	813,299					

## ●2022年1月31日の予定

*12月の商業動態統計速報	*米国1月のシカゴPM景況感指数
*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*ユーロ圏10-12月期のGDP1次速報
市場予想：前月比▲0.8%	
*12月の住宅着工統計	
*1月の消費動向調査	

◆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