

Central Daily Market Report

2021年12月13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	2021年12月13日		2021年12月14日		2021年12月15日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 1,100		▲ 2,200		▲ 2,000	
財政	▲ 300		5,500		65,000	
資金過不足	▲ 1,400		3,300		63,000	
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	10,000			▲ 10,000		
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)					20,100	▲ 28,900
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 500	300		500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	8,200		▲ 6,500		54,200	
当座預金残高	5,239,100		5,232,600		5,286,800	
準備預金残高	4,654,600					
積み終了先	4,654,600				12月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,654,600				積数 0	
非準備預金先	584,500				1日平均 0	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,637,700	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	93.33%		

●2021年12月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、各業態から堅調な資金調達ニーズが見られ、前営業日とほぼ横ばいでの水準での取引が中心となった。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.01~▲0.005%の水準で調達が見られた。一巡後は複数の先からビッドを引き下げる動きが見られたため、やや水準が低下し、▲0.04~▲0.015%のレンジの出会いで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.045~▲0.035%程度での出会い。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。また、本日は国債買現先オペが即日スタートで実施された。

<短国市場>

13日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、複数の業態から発行が実施された。発行レートは、概ね横ばいながらも期内物へのニーズがやや弱まっている。

●短期金融市場関連指標

2021/12/13	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.040	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.046	0.045	▲ 0.005	28,640.49	202.72	113.51-52	113.54-56
T/N							-	▲ 0.041						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.003				-	▲ 0.069						
2W	▲ 0.001	0.050	0.017				-	▲ 0.080						
3W							-	▲ 0.099						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.116	▲ 0.113						
6M							▲ 0.110	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.128	▲ 0.133						
									日付	12/6	12/7	12/8	12/9	12/10
									日銀当預残	5,259,800	5,261,100	5,252,800	5,259,100	5,230,900
									準備預金残	4,658,400	4,669,500	4,659,900	4,679,000	4,697,300
									マネタリーベース	6,490,900	6,493,400	6,485,900	6,494,600	6,467,400
									無担O/N加重平均	▲ 0.035%	▲ 0.028%	▲ 0.022%	▲ 0.015%	▲ 0.008%
									コール市場残高	158,449	162,304	160,009	165,954	175,343
									うち無担	139,967	144,323	142,243	148,090	154,891
									うちO/N	59,334	62,170	61,615	66,662	73,303
									うち有担	18,482	17,981	17,766	17,864	20,452

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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)		2021/12/13	2021/12/14	▲ 0.350	446	446		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/13	2021/12/14	▲ 0.350	0	0				
国債買現先・即日	20,000	2021/12/13	2021/12/14		10,000	10,000		▲ 0.060	▲ 0.060	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2021/12/15	2025/12/15	0	20,129

●2021年12月14日の予定

*米国FOMC(1日目)	*国庫短期証券(1045回)入札 (6ヶ月、34,500億円、12/16発行)
*米国11月の生産者物価指数	*流動性供給入札 (5,000億円、12/15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