

Central Daily Market Report

2021年12月14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	2021年12月14日		2021年12月15日		2021年12月16日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,200		▲ 2,200		▲ 3,000	
財政	5,000		66,300		▲ 2,000	
資金過不足	2,800		64,100		▲ 5,000	
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	20,000	▲ 10,000	29,000	▲ 20,000		▲ 28,600
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			20,100	▲ 17,900		
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 200	500		200		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増減	12,800		74,500		▲ 33,600	
当座預金残高	5,251,900		5,326,400		5,292,800	
準備預金残高	4,665,200					
積み終了先	4,665,200				12月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,665,200				積数	
非準備預金先	586,700				1日平均	
					0	
					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	96.67%		

●2021年12月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、既に調整ニーズが一服した先も見られていることから、昨日よりややレート水準が低下した。立ち上がりは、邦銀・証券業態などから▲0.03~▲0.008%の水準で調達が見られた。一巡後は、▲0.05~▲0.02%のレンジの出合いで推移した。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、▲0.065~▲0.035%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。本日は日銀による国債買現先オペが、昨日に続いてT+0でオファーされたほか、T+1でもオファーされた。これを受け、GC T/Nはレートが低下する展開となった。

<短国市場>

14日はTB6M物(1045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市場は、数件の入札にとどまった。発行レートは、期越え物へのニーズが堅調で、低位で推移した。CP等買入オペは、応札額8,261億円、按分レート▲0.014%、平均レート▲0.010%となった。

●短期金融市場関連指標

2021/12/14	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.049	0.045	0.000	28,432.64	▲ 207.85	113.57-58	113.71-73	
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.074							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.010	▲ 0.003	▲ 0.007				-	▲ 0.091							
2W	▲ 0.050	0.150	▲ 0.022				-	▲ 0.094							
3W							-	▲ 0.101							
1M	▲ 0.040	0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.103							
3M							▲ 0.116	▲ 0.114							
6M							▲ 0.115	▲ 0.122							
1Y							▲ 0.128	▲ 0.133							
										日付	12/7	12/8	12/9	12/10	12/13
										日銀当預残	5,261,100	5,252,800	5,259,100	5,230,900	5,239,100
										準備預金残	4,669,500	4,659,900	4,679,000	4,697,300	4,654,700
										マネタリーベース	6,493,400	6,485,900	6,494,600	6,467,400	6,476,800
										無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.022%	▲0.015%	▲0.008%	▲0.009%
										コール市場残高	162,304	160,009	165,954	175,343	154,740
										うち無担	144,323	142,243	148,090	154,891	136,932
										うちO/N	62,170	61,615	66,662	73,303	60,479
										うち有担	17,981	17,766	17,864	20,452	17,808

●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	1045	-	34,500	2021/12/16	2022/6/16	128,062.0	28,068.6	100.0530	▲0.1062%	6.7449%	100.0540	▲0.1082%	6,431.0
流動性供給	347	-	5,000	2021/12/15		17,457.0	4,983.00		▲0.0120%	86.2785%		▲0.0120%	

●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)		2021/12/14	2021/12/15	▲ 0.250	230	230		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/14	2021/12/15	▲ 0.250	1	1		▲ 0.250	▲ 0.250	
米ドル資金供給		2021/12/16	2021/12/23	0.330	1	1				
CP等買入	5,000	2021/12/17			8,261	4,996	▲0.014		▲0.010	3.2
国債買現先	70,000	2021/12/15	2021/12/16		28,629	28,629		▲0.100	▲0.100	
国債買現先・即日	20,000	2021/12/14	2021/12/15		22,210	20,002	▲0.100		▲0.100	90.1

●2021年12月15日の予定

*10月の第3次産業活動指数	*米国FOMC(2日目)	*国庫短期証券(1046回)入札 (1年、35,000億円、12/20発行)
	*米国FRB経済見通し発表	
	*米国10月の企業在庫	
	*米国11月の小売売上高	
	*英国11月の消費者物価指数	

◆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