

Central Daily Market Report

2021年12月21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21日		2021年12月22日		2021年12月23日	
	需給速報	需給予想	需給速報	需給予想	当社予想	当社予想
銀行券	▲ 2,700	▲ 2,600	▲ 2,700	▲ 2,600	▲ 4,000	▲ 4,000
財政	▲ 5,600	3,300	▲ 5,600	3,300	▲ 1,000	▲ 1,000
資金過不足	▲ 8,300	700	▲ 8,300	700	▲ 5,000	▲ 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			5,600	▲ 2,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			13,500			
CP等買入		▲ 300		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
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		100				
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 7,500		16,600		▲ 5,000	
当座預金残高	5,368,600		5,385,200		5,380,200	
準備預金残高	4,736,300					
積み終了先	4,735,800					
超過準備	4,735,800					
非準備預金先	632,300					
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,769,300	
準備預金進捗率	実績	99.89%	日数	19.35%		

●2021年12月21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・外銀から、前日比横ばい圏の▲0.045~▲0.002%の出合い。一巡後は▲0.06~▲0.01%で調達が見られた。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲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>

21日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物に出合いが見られた。

<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。発行レートは横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2021/12/21	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.084	0.050	0.015	28,517.59	▲ 579.78	113.66-67	113.65-67
T/N	▲ 0.043	▲ 0.010	▲ 0.034				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.010				-	-						
1W	▲ 0.025	0.250	0.014				-	▲ 0.089						
2W			0.010				-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.098						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.120	▲ 0.109						
6M							▲ 0.115	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.131						
									日付	12/14	12/15	12/16	12/17	12/20
									日銀当預残	5,251,900	5,341,300	5,307,600	5,306,900	5,376,100
									準備預金残	4,665,200	4,753,200	4,693,900	4,700,600	4,766,800
									マネタリーベース	6,491,700	6,583,300	6,553,000	6,554,600	6,625,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.022%	▲ 0.033%	▲ 0.028%	▲ 0.028%
									コール市場残高	163,780	160,027	192,164	196,015	197,540
									うち無担	145,813	141,874	174,171	177,390	179,797
									うちO/N	72,310	68,846	99,063	101,947	102,874
									うち有担	17,967	18,153	17,993	18,625	17,743

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2021/12/22	2022/1/5		5,550	5,550				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,500	2021/12/22			13,553	4,505	0.005		0.005	69.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/12/22			12,258	4,505	0.005		0.005	62.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/12/22			11,610	4,262	0.007		0.007	92.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/12/21	2021/12/22	▲ 0.350	7	7		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/21	2021/12/22	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/12/23	2021/12/30	0.330	1	1				
社債等買入(残存期間3年超5年以下)	750	2021/12/24			2,414	750	0.172		0.185	3.4

●2021年12月22日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(10月27・28日分)	*米国7-9月期のGDP確報値
	*米国11月の中古住宅販売
	*英国7-9月期のGDP確報値

◆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