

Central Daily Market Report

2021年12月22日(水)

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22日		2021年12月23日		2021年12月24日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 2,600		▲ 4,100		▲ 3,000	
財政	2,200		3,300		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 400		▲ 800		▲ 6,000	
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						
国債買入	13,500					
CP等買入		▲ 600		▲ 500		
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				800
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			100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	15,400		▲ 1,200		▲ 5,200	
当座預金残高	5,384,000		5,382,800		5,377,600	
準備預金残高	4,752,900					
積み終了先	4,752,400		12月23日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,752,400		積数		3,800	
非準備預金先	631,100		1日平均		200	
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	99.90%	日数	22.58%		

●2021年12月22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・外銀より、▲0.055~▲0.003%の調達で始まった。一巡後は▲0.06~▲0.01%で調達が見られた。ターム物は月内物の引き合いが散見された程度であった。

<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>

22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、五・十日の前倒し発行にあたり、幅広い業態から大型発行が見られた。発行レートに大きな変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/12/22	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)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.028				-	▲ 0.086	0.055	0.005	28,562.21	44.62	113.99-01	114.14-16
T/N	▲ 0.043	▲ 0.010	▲ 0.034				-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.020				-	▲ 0.089						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.095						
3W							-	▲ 0.096						
1M			▲ 0.005				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.123	▲ 0.109						
6M							▲ 0.115	▲ 0.120						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.131						
									日付	12/15	12/16	12/17	12/20	12/21
									日銀当預残	5,341,300	5,307,600	5,306,900	5,376,100	5,368,600
									準備預金残	4,753,200	4,693,900	4,700,600	4,766,800	4,736,500
									マネタリーベース	6,583,300	6,553,000	6,554,600	6,625,700	6,620,900
									無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.033%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.028%
									コール市場残高	160,027	192,164	196,015	197,540	198,246
									うち無担	141,874	174,171	177,390	179,797	180,445
									うちO/N	68,846	99,063	101,947	102,874	102,062
									うち有担	18,153	17,993	18,625	17,743	17,801

●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)		2021/12/22	2021/12/23	▲ 0.350	85	85		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/22	2021/12/23	▲ 0.350	0	0				

●2021年12月23日の予定

*黒田日銀総裁、日本経済団体連合会審議会において講演	*米国11月の新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札(5,000億円、12/24発行)
*10月の景気動向指数改訂状況	*米国11月の耐久財新規受注	
	*米国11月の個人所得・消費支出	

◆本資料は信頼できるとさ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