

# Central Daily Market Report

2021年12月23日(木)

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23日 需給速報	2021年12月24日 需給予想	2021年12月27日 当社予想	
銀行券	▲ 4,200	▲ 2,900	▲ 3,000	
財政	3,200	4,600	1,000	
資金過不足	▲ 1,000	1,700	▲ 2,000	
<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	▲ 500	▲ 800		
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援				
社債等買入		800	▲ 100	
新型コロナウイルス対応金融支援特別			▲ 107,800	
気候変動対応オペ		20,500		
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 100	100	100	
※ドル資金供給用担保提供供給				
当預増減	▲ 1,500	22,200	▲ 109,800	
当座預金残高	5,382,500	5,404,700	5,294,900	
準備預金残高	4,756,800			
積み終了先	4,756,400			
超過準備	4,756,300			
非準備預金先	625,700			
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	99.91%	日数	25.81%

## ●2021年12月23日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢より▲0.06~▲0.001%の調達で始まった。一部では取り上がる動きも見られた。一巡後は▲0.055~▲0.01%の出会いで本日の取引を終えた。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、▲0.075~▲0.055%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>

23日のアウトライ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、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

2021/12/23	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	▲ 0.027				-	▲ 0.082	0.060	0.005	28,798.37	236.16	114.13-14	114.25-27
T/N	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.022				-	▲ 0.074						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.084						
2W							-	▲ 0.089						
3W							-	▲ 0.092						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.123	▲ 0.108						
6M							▲ 0.115	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.130						
									日付	12/16	12/17	12/20	12/21	12/22
									日銀当預残	5,307,600	5,306,900	5,376,100	5,368,600	5,384,000
									準備預金残	4,693,900	4,700,600	4,766,800	4,736,500	4,753,000
									マネタリーベース	6,553,000	6,554,600	6,625,700	6,620,900	6,638,900
									無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.028%
									コール市場残高	192,164	196,015	197,540	198,246	200,593
									うち無担	174,171	177,390	179,797	180,445	183,000
									うちO/N	99,063	101,947	102,874	102,062	102,817
									うち有担	17,993	18,625	17,743	17,801	17,593

## ●入札結果

名称	回数	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)
流動性供給	348	-	5,000	2021/12/24		10,366.0	4,993.0		0.0040%	23.8095%		0.0000%	

## ●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)		2021/12/23	2021/12/24	▲ 0.350	108	108		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/23	2021/12/24	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
気候変動対応支援オペ	2021/12/24	2023/1/30	0	20,483

## ●2021年12月24日の予定

*11月の全国消費者物価指数(GPI) 市場予想:前年同月比(除く生鮮) +0.4%	*New Yor祝日(Christmas Day, observed)
*11月の企業向けサービス価格指数	*EURO祝日(Christmas Eve)
*11月の住宅着工統計	
*クリスマスイブ	

◆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