

Central Daily Market Report

2021年12月24日(金)

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24日 需給速報	2021年12月27日 需給予想	2021年12月28日 当社予想	
銀行券	▲ 2,900	▲ 3,000	▲ 2,000	
財政	4,200	20,100	▲ 4,000	
資金過不足	1,300	17,100	▲ 6,000	
金融調節	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通				
国債買現		15,200		
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入		9,500		
CP等買入		▲ 800	▲ 1,000	
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		124,700	▲ 107,700	
気候変動対応オペ	20,500			
E T F 買入				
国債補完供給		100		
ドル基金供給用担保提供供給				
当預増減	21,800	57,800	▲ 6,000	
当座預金残高	5,404,300	5,462,100	5,456,100	
準備預金残高	4,798,200			
積み終了先	4,797,800	12月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,797,800	積数	2,200	
非準備預金先	606,100	1日平均	100	
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	99.94%	日数	35.48%

●2021年12月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、GCLレートの上昇や週末要因により取り上がる動きが見られた。朝方は幅広い業態より▲0.055~▲0.001%の出会い。一巡後は▲0.04~▲0.01%の調達が見られた。ターム物は閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.07~▲0.065%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T+1スタート(12/27~12/30)で15,000億円オファーされた。

<短国市場>

24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。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2021/12/24	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.023				-	▲ 0.067	0.060	0.000	28,782.59	▲ 15.78	114.46-47	114.34-38
T/N	▲ 0.045	▲ 0.010	▲ 0.025				-	▲ 0.079						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.084						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.088						
3W							-	▲ 0.091						
1M			▲ 0.017				-	▲ 0.096						
3M							▲ 0.123	▲ 0.108						
6M							▲ 0.115	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.129						
									日付	12/17	12/20	12/21	12/22	12/23
									日銀当預残	5,306,900	5,376,100	5,368,600	5,384,000	5,382,500
									準備預金残	4,700,600	4,766,800	4,736,500	4,753,000	4,756,800
									マネタリーベース	6,554,600	6,625,700	6,620,900	6,638,900	6,641,500
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.027%
									コール市場残高	196,015	197,540	198,246	200,593	199,560
									うち無担	177,390	179,797	180,445	183,000	181,088
									うちO/N	101,947	102,874	102,062	102,817	100,485
									うち有担	18,625	17,743	17,801	17,593	18,472

●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)	発札総額(億円・百万ドル)	抜付レート・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均発札レート・利回差・価格差	抜付比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2021/12/27			9,475	4,504	▲0.002		0.000	92.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,250	2021/12/27			10,574	4,253	▲0.001		0.000	10.3
国債買入(物価連動債)	600	2021/12/27			1,873	600	0.040		▲0.075	95.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/12/24	2021/12/27	▲0.350	41	41		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/24	2021/12/27	▲0.350	0	0				
国債買現先	15,000	2021/12/27	2021/12/30		20,037	15,002	▲0.100		▲0.086	35.2
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2021/12/27時点の貸出残高(億円)					
新型コロナウイルス対応金融支援特別	2021/12/27	2022/6/28	0	124,679	821,939					

●2021年12月27日の予定

*決定会合における主な意見(12月16・17日分)	*London祝日(Christmas Day, substitute)	*2年利付国債入札(30,000億円、1/4発行)
*11月の商業動態統計速報		

◆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