

Central Daily Market Report

2021年12月27日(月)

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27日 需給速報	2021年12月28日 需給予想	2021年12月29日 当社予想			
銀行券	▲ 3,000	▲ 3,200	▲ 2,000			
財政	20,900	▲ 1,400	▲ 5,000			
資金過不足	17,900	▲ 4,600	▲ 7,000			
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	15,200					
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,500					
CP等買入		▲ 1,000		▲ 1,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 200			200		
*ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	58,400	▲ 5,700		▲ 7,000		
当座預金残高	5,462,700	5,457,000		5,450,000		
準備預金残高	4,856,000					
積み終了先	4,855,600				12月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,855,600				積数	1,800
非準備預金先	606,700				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	99.95%		日数		38.71%

●2021年12月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.055~▲0.01%の調達で始まった。引き続き調達ニーズは根強く、本日も取り上がる動きが見られた。一巡後も朝方と同水準の取引が見られ、本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合いなく、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.080~▲0.070%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>

27日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M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。発行レートに目立った変化は見られなかった。本日はCP等買入オペが実施された。結果は平均落札レート▲0.011%・按分レート▲0.014%と、前回(平均▲0.010%・按分▲0.014%)比で平均レートは低下し、按分レートは横ばいとなった。

●短期金融市場関連指標

2021/12/27	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	▲ 0.021				-	▲ 0.076	0.060	0.000	28,676.46	▲ 106.13	114.34-36	114.46-48
T/N	▲ 0.015	▲ 0.010	▲ 0.014				-	▲ 0.078						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.084						
2W							-	▲ 0.086						
3W							-	▲ 0.090						
1M	▲ 0.001	0.480	0.015				-	▲ 0.095						
3M							▲ 0.119	▲ 0.107						
6M							▲ 0.115	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.130						
									日付	12/20	12/21	12/22	12/23	12/24
									日銀当預残	5,376,100	5,368,600	5,384,000	5,382,500	5,404,300
									準備預金残	4,766,800	4,736,500	4,753,000	4,756,800	4,798,400
									マネタリーベース	6,625,700	6,620,900	6,638,900	6,641,500	6,666,200
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.028%	▲0.028%	▲0.027%	▲0.023%
									コール市場残高	197,540	198,246	200,593	199,560	195,397
									うち無担	179,797	180,445	183,000	181,088	177,732
									うちO/N	102,874	102,062	102,817	100,485	96,759
									うち有担	17,743	17,801	17,593	18,472	17,665

●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)
2年利付国債	432	0.005%	30,000	2022/1/4	2024/1/1	104,322.0	24,555.0	100.1900	▲0.0900%	8.3284%	100.1960	▲0.0930%	5,436.0

●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
CP等買入	5,000	2021/12/30			7,760	4,997	▲0.014		▲0.011	44.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/12/27	2021/12/28	▲0.350	141	141		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/27	2021/12/28	▲0.350	2	2		▲0.350	▲0.350	

●2021年12月28日の予定

*11月の完全失業率(市場予想：2.7%)
*11月の有効求人倍率(市場予想：1.16倍)
*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+4.8%)

*米国10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*米国12月のCB消費者信頼感指数
*London祝日(Boxing Day, substitute)

◆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