

Central Daily Market Report

2022年12月1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	2022年12月1日 需給速報		2022年12月2日 需給予想		2022年12月5日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 600		▲ 500	
財政	▲ 53,700		▲ 105,700		▲ 4,000	
資金過不足	▲ 54,700		▲ 106,300		▲ 4,500	
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						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	1,400		15,400			
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)				▲ 3,100		
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 気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 8,600	8,400		8,600		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 53,600		▲ 85,600		▲ 4,500	
当座預金残高	4,887,500		4,801,900		4,797,400	
準備預金残高	4,232,100					
積み終了先	4,231,600		12月2日以降の残り所要積立額		積数 4,600	
超過準備	4,231,300				1日平均 300	
非準備預金先	655,400					
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,767,900	
準備預金進捗率	実績	99.88%	日数	53.33%		

●2022年12月1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▲0.087~▲0.078%程度の調達でまとまった。月末要因は剥落したものの、引き続きビッドが少なく、一巡後は閑散とした状況となり本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.12~▲0.10%程度での出会いとなった。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>

1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、一部で大型発行が行われた。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/12/1	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.079				-	▲ 0.104	0.250	0.000	28,226.08	257.09	137.34-38	136.52-55
T/N							-	▲ 0.119						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.124						
2W	▲ 0.075	0.180	▲ 0.037				-	▲ 0.125						
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.132						
1M							-	▲ 0.154						
3M							▲ 0.200	▲ 0.139						
6M							▲ 0.130	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.129						
									日付	11/24	11/25	11/28	11/29	11/30
									日銀当預残	4,904,700	4,943,400	4,933,100	4,939,700	4,941,100
									準備預金残	4,258,300	4,296,800	4,268,200	4,271,200	4,293,000
									マネタリーベース	6,161,000	6,200,100	6,190,000	6,197,100	6,199,200
									無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.075%	▲0.077%	▲0.078%	▲0.079%
									コール市場残高	163,898	169,682	163,313	158,945	155,729
									うち無担	132,235	137,926	132,910	129,595	127,406
									うちO/N	64,303	70,594	65,698	62,393	64,954
									うち有担	31,663	31,756	30,403	29,350	28,323

●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	368	0.20%	27,000	2022/12/2	2032/9/20	137,353.0	22,784.00	99.5200	0.2500%	40.8288%	99.5200	0.2500%	4,204.0	4.35
交付税特会	-	-	13,000	2022/12/9	2023/6/9	465,678.0	12,990.26	-	0.0000%	2.7896%	-	0.0000%	-	10.00

●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)		2022/12/1	2022/12/2	▲ 0.350	8,575	8,575		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/1	2022/12/2	▲ 0.350	29	29		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/12/2		0.000	15,465	15,465				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/2		0.036	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2022/12/2		0.020	0	0				

*オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り。国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。※1固定利回較差の結果、10年利付国債368回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けず。※2固定利回較差の結果、10年利付国債357回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。※3固定利回較差の結果、10年利付国債358回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年12月2日の予定

*11月のマネタリーベース	*11月の米雇用統計	*国庫短期証券(1124回)入札 (3ヶ月、60,000億円、12/5発行)
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み		

◆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