

Central Daily Market Report

2022年12月5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	2022年12月5日 需給速報	2022年12月6日 需給予想	2022年12月7日 当社予想			
銀行券	▲ 1,100	▲ 400	▲ 1,500			
財政	1,400	700	▲ 9,000			
資金過不足	300	300	▲ 10,500			
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						▲ 1,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	13,100		700			
CP等買入		▲ 700				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 300				
新型コロナウイルス対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 9,600	9,100	9,600			
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	11,900	10,600	▲ 12,000			
当座預金残高	4,806,200	4,816,800	4,804,800			
準備預金残高	4,174,900					
積み終了先	4,174,600			12月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,174,400			積数	2,800	
非準備預金先	631,300			1日平均	300	
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	99.93%	日数	66.67%		

●2022年12月5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~▲0.077%程度の調達で始まった。積み最終日に向けた調整から、ビッド数がやや増加したものの、レート水準に大きな変化は見られなかった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで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、▲0.11~▲0.10%程度での出合いとなった。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>

5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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/12/5	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	▲ 0.078				-	▲ 0.102	0.250	0.000	27,820.40	42.50	134.48-49	135.12-14
T/N							-	▲ 0.107						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.078	▲ 0.070	▲ 0.077				-	▲ 0.117						
2W							-	▲ 0.123						
3W			0.050				-	▲ 0.127						
1M							-	▲ 0.153						
3M			0.220				▲ 0.170	▲ 0.139						
6M							▲ 0.130	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.128						
									日付	11/28	11/29	11/30	12/1	12/2
									日銀当預残	4,933,100	4,939,700	4,941,100	4,887,500	4,794,300
									準備預金残	4,268,200	4,271,200	4,293,000	4,232,000	4,150,600
									マネタリーベース	6,190,000	6,197,100	6,199,200	6,146,600	6,054,000
									無担O/N加重平均	▲0.077%	▲0.078%	▲0.079%	▲0.079%	▲0.078%
									コール市場残高	163,313	158,945	155,729	158,734	155,567
									うち無担	132,910	129,595	127,406	128,300	124,439
									うちO/N	65,698	62,393	64,954	61,488	57,627
									うち有担	30,403	29,350	28,323	30,434	31,128

●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)		2022/12/5	2022/12/6	▲ 0.350	9,555	9,555		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/5	2022/12/6	▲ 0.350	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/12/6		0.000	723	723				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/6		0.055	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		2022/12/6		0.040	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6日の予定

*10月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比+1.0%)	*10月の米貿易収支	*30年利付国債入札 (9,000億円、12/7発行)
*10月の毎月勤労統計調査速報		*交付税特別会計借入 (13,000億円、12/15借入)

◆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