

Central Daily Market Report

2022年12月7日(水)

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7日 需給速報	2022年12月8日 需給予想	2022年12月9日 当社予想			
銀行券	▲ 1,300	▲ 2,900	▲ 3,500			
財政	▲ 13,000	▲ 2,900	▲ 23,000			
資金過不足	▲ 14,300	▲ 5,800	▲ 26,500			
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	▲ 1,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入	1,000		12,900			
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 200				
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 11,100	12,300		11,100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 11,500		18,100		▲ 26,500	
当座預金残高	4,793,200		4,811,300		4,784,800	
準備預金残高	4,168,200					
積み終了先	4,166,400			12月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,166,400			積数	28,500	
非準備預金先	625,000			1日平均	3,600	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,836,100	
準備預金進捗率	実績	99.26%	日数	73.33%		

●2022年12月7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%程度の調達となった。積み最終日に向けた調整から、取り手サイドのネームに出入りが見られるものの、全体的な調達ニーズに大きな変化は無く、レートへの影響も限定的となっている。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、▲0.10~▲0.09%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>

7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発行市場は複数の発行が観測され、一部の業態で大型発行が実施された。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

2022/12/7	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	▲ 0.077				-	▲ 0.098	0.250	0.000	27,686.40	▲ 199.47	136.88-89	137.41-44
T/N							-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.109						
2W							-	▲ 0.120						
3W			0.040				-	▲ 0.123						
1M							-	▲ 0.152						
3M			0.023				▲ 0.170	▲ 0.139						
6M							▲ 0.128	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.110	▲ 0.125						
日付		11/30	12/1	12/2	12/5	12/6								
日銀当預残	4,941,100	4,887,500	4,794,300	4,806,200	4,804,700									
準備預金残	4,293,000	4,232,000	4,150,600	4,175,500	4,176,300									
マネタリーベース	6,199,200	6,146,600	6,054,000	6,066,900	6,065,900									
無担O/N加重平均	▲ 0.079%	▲ 0.079%	▲ 0.078%	▲ 0.078%	▲ 0.078%									
コール市場残高	155,729	158,734	155,567	162,776	159,493									
うち無担	127,406	128,300	124,439	130,919	128,223									
うちO/N	64,954	61,488	57,627	64,797	60,521									
うち有担	28,323	30,434	31,128	31,857	31,270									

●入札結果

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)	抜分レート ・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	抜分 比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/12/8			11,996	4,755	0.003		0.004	50.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/12/8			21,010	5,509	▲0.002		▲0.001	44.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2022/12/8			3,546	2,507	▲0.012		▲0.010	15.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/12/7	2022/12/8	▲ 0.350	11,065	11,065		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/7	2022/12/8	▲ 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		2022/12/8		0.000	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/8		0.040	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		2022/12/8		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オファー。※2固定利回較差の結果、10年利付国債37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8日の予定

*7-9月期のGDP 2次速報(市場予想:前期比年率▲1.1%)
*10月の国際収支
*11月の景気ウォッチャー調査

*国庫短期証券(1125回)入札
(6ヶ月、40,000億円、12/12発行)
*5年利付国債入札(25,000億円、12/9発行)
*エネルギー対策借入(6,800億円、12/20借入)

◆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