Central Daily Market Report

2022年12月9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	2022年12月9日 需給速報		2022年12月12日 需給予想		2022年12月13日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,100		▲ 2,500	
財政	▲ 25,900		▲ 14,400		1,000	
資金過不足	▲ 27,300		▲ 15,500		▲ 1,500	
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	200		100			
CP等買入		▲ 800			4,000	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 11,000	12,200		11,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 26,700		▲ 4,600		2,500	

当座預金残高	4,773,300	4,768,700	4,771,200
準備預金残高	4,160,100		
積み終了先	4,158,300	12月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,158,300	積数	21,300
非準備預金先	613,200	1日平均	5,300
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 99.44%	日数	86.67%

●2022年12月9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～▲0.075%程度の調達となった。今積み期最後の週末3日積みとなった事で、最終日に向けた調整から調達ニーズがやや高まり、レート水準は上昇した。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、▲0.095～▲0.085%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>

9日はTB3M物（第1126回）の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、しっかりと推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2022/12/9	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.077				－	▲ 0.097
T/N							－	▲ 0.099
S/N							－	－
1W			▲ 0.074				－	▲ 0.107
2W							－	▲ 0.117
3W			▲ 0.069				－	▲ 0.152
1M							－	▲ 0.151
3M							▲ 0.180	▲ 0.138
6M							▲ 0.147	▲ 0.130
1Y							▲ 0.112	▲ 0.125

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.250	0.000	27,901.01	326.58	136.62-64	136.34-36

日付	12/2	12/5	12/6	12/7	12/8
日銀当預残	4,794,300	4,806,200	4,804,700	4,793,200	4,800,000
準備預金残	4,150,600	4,175,500	4,176,300	4,168,500	4,184,800
マネタリーベース	6,054,000	6,066,900	6,065,900	6,055,700	6,065,500
無担O/N加重平均	▲0.078%	▲0.078%	▲0.078%	▲0.077%	▲0.077%
コール市場残高	155,567	162,776	159,493	162,441	168,172
うち無担	124,439	130,919	128,223	131,784	138,054
うちO/N	57,627	64,797	60,521	63,732	68,662
うち有担	31,128	31,857	31,270	30,657	30,118

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1126	－	60,000	2022/12/12	2023/3/20	169,512.0	48,730.00	100.0425	▲0.1582%	80.0000%	100.0459	▲0.1708%	11,270.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/12/9	2022/12/12	▲ 0.350	10,942	10,942		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/9	2022/12/12	▲ 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		2022/12/12		0.000	124	124				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/12/12		0.060	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		2022/12/12		0.050	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
※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12日の予定

*11月の企業物価指数
*10-12月期の法人企業景気予測調査季報
*11月の米財政収支

◆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。
◆本資料は何ら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論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