

Central Daily Market Report

2022年12月12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12日 需給速報 | 2022年12月13日 需給予想 | 2022年12月14日 当社予想 | | | |
|-------------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|------------------|-----------|----------|
| 銀行券 | ▲ 1,100 | ▲ 2,200 | ▲ 1,000 | | | |
| 財政 | ▲ 14,700 | 5,500 | ▲ 7,000 | | | |
| 資金過不足 | ▲ 15,800 | 3,300 | ▲ 8,000 | | | |
| 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 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | 100 | 200 | | | | |
| CP等買入 | | 4,000 | ▲ 200 | | | |
| 貸出支援基金(成) | | | | | | |
| 貸出支援基金(貸) | | | | | | ▲ 17,400 |
| 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 | | | | | | |
| E T F 買入 | | | | | | |
| 国債補完供給 | ▲ 12,300 | 11,000 | 12,300 | | | |
| ※ドル資金供給用担保提供供給 | | | | | | |
| 当預増減 | ▲ 17,200 | 19,600 | ▲ 25,400 | | | |
| 当座預金残高 | 4,756,100 | 4,775,700 | 4,750,300 | | | |
| 準備預金残高 | 4,159,100 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,157,300 | | | 12月13日以降の残り所要積立額 | | |
| 超過準備 | 4,157,300 | | | 積数 | 19,500 | |
| 非準備預金先 | 597,000 | | | 1日平均 | 6,500 | |
| 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 | 99.49% | 日数 | 90.00% | | |

●2022年12月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、週末3日積み要因が剥落したものの概ね横ばい圏での推移となった。積み最終日に向けた調整が一部で見られたものの、レートへの影響は限定的であり、邦銀業態の調達を中心に▲0.087~▲0.075%近辺での出会いとなった。
ターム物は、ショートターム物での引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.075%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>

12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、概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

| 2022/12/12 | 無担(速報) | | | 有担(速報) | | | 短国 | 東京 レポレート | 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 | 売買参考統計値 | 平均値 | 直近値 | 前日比 | 15時時点 | 前日比 | 為替(9時) | 為替(17時) |
| O/N | ▲ 0.087 | 0.001 | ▲ 0.077 | | | | | - | ▲ 0.089 | 0.250 | 0.000 | 27,842.33 | ▲ 58.68 | 136.71-74 | 136.68-70 |
| T/N | | | | | | | | - | ▲ 0.087 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | | | ▲ 0.068 | | | | | - | ▲ 0.102 | | | | | | |
| 2W | | | | | | | | - | ▲ 0.112 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | | - | ▲ 0.152 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | | - | ▲ 0.151 | | | | | | |
| 3M | | | | | | | | ▲ 0.180 | ▲ 0.137 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | | ▲ 0.147 | ▲ 0.130 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | | ▲ 0.112 | ▲ 0.126 | | | | | | |
| 日付 | 12/5 | 12/6 | 12/7 | 12/8 | 12/9 | | | | | | | | | | |
| 日銀当預残 | 4,806,200 | 4,804,700 | 4,793,200 | 4,800,000 | 4,773,300 | | | | | | | | | | |
| 準備預金残 | 4,175,500 | 4,176,300 | 4,168,500 | 4,184,800 | 4,160,100 | | | | | | | | | | |
| マネタリーベース | 6,066,900 | 6,065,900 | 6,055,700 | 6,065,500 | 6,040,200 | | | | | | | | | | |
| 無担O/N加重平均 | ▲ 0.078% | ▲ 0.078% | ▲ 0.077% | ▲ 0.077% | ▲ 0.077% | | | | | | | | | | |
| コール市場残高 | 162,776 | 159,493 | 162,441 | 168,172 | 167,289 | | | | | | | | | | |
| うち無担 | 130,919 | 128,223 | 131,784 | 138,054 | 136,932 | | | | | | | | | | |
| うちO/N | 64,797 | 60,521 | 63,732 | 68,662 | 68,890 | | | | | | | | | | |
| うち有担 | 31,857 | 31,270 | 30,657 | 30,118 | 30,357 | | | | | | | | | | |

●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) | 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) | | 2022/12/12 | 2022/12/13 | ▲ 0.350 | 12,176 | 12,176 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2022/12/12 | 2022/12/13 | ▲ 0.350 | 152 | 152 | | ▲ 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 | | 2022/12/13 | | 0.000 | 155 | 155 | | | | |
| 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2 | | 2022/12/13 | | 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 | | 2022/12/13 | | 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。

| 種類 | スタート日 | エンド日 | 貸付 利率 | 貸付予定総額 (億円) | |
|----------|--------------|------------|------------|----------------|--------|
| 貸出増加支援オペ | 貸付期間4年(新規貸付) | 2022/12/14 | 2026/12/14 | 0 | 36,712 |

●2022年12月13日の予定

*米FOMC(1日目)

*11月の米消費者物価指数

*流動性供給入札

(5,000億円、12/14発行)

◆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