Central Daily Market Report

2022年12月13日（火）
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13日 需給速報	2022年12月14日 需給予想	2022年12月15日 当社予想
銀行券	▲ 2,200	▲ 2,400	▲ 500
財政	5,200	2,500	74,000
資金過不足	3,000	100	73,500

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			1,000			
国債買入	200		100			
CP等買入	4,000	▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）			36,700	▲ 14,300		
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 13,300	12,300		13,300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	6,000		36,600		73,500	

当座預金残高	4,762,100	4,798,700	4,872,200
準備預金残高	4,203,800		
積み終了先	4,202,000		
超過準備	4,202,000		
非準備預金先	558,300		

12月14日以降の残り所要積立額	
積数	17,700
1日平均	8,800

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	99.54%	日数 93.33%

●2022年12月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀業態からの調達を中心に▲0.085～▲0.073%近辺での出合いとなった。積み最終日に向けた調整から、一部で積極的な調達が見られた事で、出合い水準は小幅に上昇する展開となった。
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、▲0.09～▲0.08%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>

13日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。また、マーケットで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、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。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

2022/12/13	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	▲ 0.075				－	▲ 0.086
T/N							－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W	▲ 0.076	▲ 0.074	▲ 0.075				－	▲ 0.098
2W							－	▲ 0.106
3W							－	▲ 0.153
1M							－	▲ 0.151
3M							▲ 0.180	▲ 0.138
6M							▲ 0.147	▲ 0.130
1Y							▲ 0.112	▲ 0.126

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	27,954.85	112.52	137.48-50	137.40-43

日付	12/6	12/7	12/8	12/9	12/12
日銀当預残	4,804,700	4,793,200	4,800,000	4,773,300	4,756,100
準備預金残	4,176,300	4,168,500	4,184,800	4,160,100	4,159,100
マネタリーベース	6,065,900	6,055,700	6,065,500	6,040,200	6,024,000
無担O/N加重平均	▲0.078%	▲0.077%	▲0.077%	▲0.077%	▲0.077%
コール市場残高	159,493	162,441	168,172	167,289	169,920
うち無担	128,223	131,784	138,054	136,932	136,881
うちO/N	60,521	63,732	68,662	68,890	69,339
うち有担	31,270	30,657	30,118	30,357	33,039

●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)
流動性供給	371	－	5,000	2022/12/14		27,417.0	4,989.0		▲0.0010%	43.1263%		▲0.0030%	

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/12/14			6,817	1,000	0.007		0.012	29.5
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/12/13	2022/12/14	▲ 0.350	13,223	13,223		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/13	2022/12/14	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/12/15	2022/12/22	4.530	1	1				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/12/14		0.000	140	140				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/12/14		0.035	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		2022/12/14		0.030	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14日の予定

*12月調査の日銀短観（概要及び要旨）
（市場予想：大企業・製造業の業況判断指数（DI）+6）
*10月の機械受注統計
（市場予想：船舶、電力除く民需、前月比+2.6%）
*米FOMC（2日目）
*FRB 米経済見通し発表
*11月の英消費者物価指数

◆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