

Central Daily Market Report

2022年12月14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14日 需給速報		2022年12月15日 需給予想		2022年12月16日 当社予想	
銀行券	▲ 2,400		▲ 3,000		▲ 2,000	
財政	3,300		73,900		16,000	
資金過不足	900		70,900		14,000	
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	1,000					
国債買入	100		16,200			
CP等買入		▲ 200		▲ 800		
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				
新型コロナウイルス対応金融支援特別 氣候変動対応オペ						
E T F買入			700			
国債補完供給	▲ 11,100	13,300		11,100		
※1日平均金供給用担保提供倍率						
当預増減	26,300		98,100		14,000	
当座預金残高	4,788,400		4,886,500		4,900,500	
準備預金残高	4,235,100					
積み終了先	4,235,100		12月15日以降の残り所要積立額		0	
超過準備	4,234,800		積数		0	
非準備預金先	553,300		1日平均		0	
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,771,000	
準備預金進捗率	実績 100.00%		日数		96.67%	

●2022年12月14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▲0.08~▲0.065%近辺での出会いとなった。昨日に引き続き、積み最終日に向けた積極的な調達が見られた事で、出会い水準は一段と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>

14日のアウトライ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。

●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。

●短期金融市場関連指標

2022/12/14	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.086
T/N							-	▲ 0.087
S/N							-	-
1W			▲ 0.074				-	▲ 0.100
2W	▲ 0.075	▲ 0.003	▲ 0.069				-	▲ 0.109
3W							-	▲ 0.151
1M							-	▲ 0.149
3M			0.001				▲ 0.180	▲ 0.137
6M							▲ 0.148	▲ 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	28,156.21	201.36	135.55-56	135.46-48

日付	12/7	12/8	12/9	12/12	12/13
日銀当預残	4,793,200	4,800,000	4,773,300	4,756,100	4,762,100
準備預金残	4,168,500	4,184,800	4,160,100	4,159,100	4,203,800
マネタリーベース	6,055,700	6,065,500	6,040,200	6,024,000	6,032,200
無担O/N加重平均	▲0.077%	▲0.077%	▲0.077%	▲0.077%	▲0.075%
コール市場残高	162,441	168,172	167,289	169,920	171,925
うち無担	131,784	138,054	136,932	136,881	138,718
うちO/N	63,732	68,662	68,890	69,339	71,056
うち有担	30,657	30,118	30,357	33,039	33,207

●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)	採分レート ・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	採分 比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/12/15			8,653	4,754	▲0.003		▲0.001	28.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/12/15			8,815	4,757	▲0.003		▲0.002	71.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/12/15			19,686	5,511	▲0.002		▲0.001	15.8
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2022/12/15			2,553	1,005	▲0.015		▲0.014	79.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/12/14	2022/12/15	▲ 0.350	11,034	11,034		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/14	2022/12/15	▲ 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		2022/12/15		0.000	238	238				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/15		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		2022/12/15		0.025	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15日の予定

*11月の貿易統計 *10月の第3次産業活動指数	*ECB定例理事会(金融政策発表) *英中銀MPC結果発表 *11月の米小売売上高 *11月の米鉱工業生産・設備稼働率 *10月の米企業在庫	*20年利付国債入札 (12,000億円、12/16発行)
-----------------------------	--	----------------------------------

◆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の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