

# Central Daily Market Report

2022年12月15日(木)  
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15日 需給速報		2022年12月16日 需給予想		2022年12月19日 当社予想	
銀行券	▲ 3,000		▲ 1,400		▲ 1,000	
財政	75,000		20,800		▲ 4,000	
資金過不足	72,000		19,400		▲ 5,000	
<b>金融調節</b>	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	16,200		3,000			
CP等買入		▲ 800		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別 氣候変動対応オペ						
E T F買入	700					
国債補完供給	▲ 13,400	11,100		13,400		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	85,800		34,900		▲ 5,000	
当座預金残高	4,874,200		4,909,100		4,904,100	
準備預金残高	4,307,200					
積み終了先	4,307,200		12月16日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,307,200		積数		3,904,800	
非準備預金先	567,000		1日平均		126,000	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,904,800	
準備預金進捗率	実績	0.00%		日数	0.00%	

## ●2022年12月15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▲0.075~▲0.05%近辺での出会いとなった。積み最終日にあたり、着地に向けた調整から積極的な調達が見られた事で、出会い水準は上昇する展開となった。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>

15日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、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

2022/12/15	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.086	0.250	0.000	28,051.70	▲ 104.51	135.34-36	135.85-87
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.075				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.076	▲ 0.035	▲ 0.070				-	▲ 0.109						
3W							-	▲ 0.153						
1M							-	▲ 0.148						
3M			0.010				▲ 0.195	▲ 0.139						
6M							▲ 0.150	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.112	▲ 0.126						
日付		12/8	12/9	12/12	12/13	12/14								
日銀当預残	4,800,000	4,773,300	4,756,100	4,762,100	4,788,400									
準備預金残	4,184,800	4,160,100	4,159,100	4,203,800	4,236,500									
マネタリーベース	6,065,500	6,040,200	6,024,000	6,032,200	6,060,900									
無担O/N加重平均	▲ 0.077%	▲ 0.077%	▲ 0.077%	▲ 0.075%	▲ 0.068%									
コール市場残高	168,172	167,289	169,920	171,925	177,139									
うち無担	138,054	136,932	136,881	138,718	145,004									
うちO/N	68,662	68,890	69,339	71,056	77,942									
うち有担	30,118	30,357	33,039	33,207	32,135									

## ●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1非価格競争入札(億円)
20年利付国債	182	1.100%	12,000	2022/12/16	2042/9/20	28,541.0	9,831.00	99,9500	1.1030%	81.4814%	100.1800	1.0880%	2,166.0

## ●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)		2022/12/15	2022/12/16	▲ 0.350	13,388	13,388		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/15	2022/12/16	▲ 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		2022/12/16		0.000	2,967	2,967				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/16		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		2022/12/16		0.030	0	0				
社債等買入	1,000	2022/12/20			1,580	1,000	0.202		0.223	95.7

\*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16日の予定

*10月の石油等消費動態統計	*11月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(1127回)入札(3ヶ月、60,000億円、12/19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り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