

Central Daily Market Report

2022年12月19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19日 需給速報	2022年12月20日 需給予想	2022年12月21日 当社予想	
銀行券	▲ 1,900	▲ 2,600	▲ 3,000	
財政	800	81,800	▲ 9,000	
資金過不足	▲ 1,100	79,200	▲ 12,000	
金融調節				
	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通			4,700 ▲ 1,500	
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入	1,400	30,500		
CP等買入	▲ 100	▲ 400		
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	1,000 ▲ 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				
国債補充供給	▲ 20,000	17,900	20,000	
※ドル資金供給用担保債供給				
当預増減	▲ 2,000	133,300	▲ 12,000	
当座預金残高	4,888,600	5,021,900	5,009,900	
準備預金残高	4,287,200			
積み終了先	4,277,900	12月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,271,900	積数	31,900	
非準備預金先	601,400	1日平均	1,200	
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	99.18%	日数	12.90%

●2022年12月19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・外銀・証券業態からの調達を中心に▲0.08~▲0.055%近辺での出会いとなった。調達スタンスの違いから出会いレンジはややワイドとなったが、概ね横ばい圏での推移となった。ターム物はショートタームで▲0.07%近辺の出会いが散見された。

<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>

19日はTB1Y物(第1128回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/12/19	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.086	0.250	0.000	27,237.64	▲ 289.48	136.57-59	135.83-85		
T/N							-	▲ 0.091								
S/N							-	-								
1W							-	▲ 0.099								
2W							-	▲ 0.162								
3W							-	▲ 0.155								
1M	0.012	0.020	0.013				-	▲ 0.151								
3M			0.025				▲ 0.150	▲ 0.137								
6M							▲ 0.128	▲ 0.130								
1Y							▲ 0.065	▲ 0.122								
											日付	12/12	12/13	12/14	12/15	12/16
											日銀当預残	4,756,100	4,762,100	4,788,400	4,874,200	4,890,600
											準備預金残	4,159,100	4,203,800	4,236,500	4,307,300	4,285,200
											マネタリーベース	6,024,000	6,032,200	6,060,900	6,149,700	6,167,500
											無担O/N加重平均	▲ 0.077%	▲ 0.075%	▲ 0.068%	▲ 0.064%	▲ 0.072%
											コール市場残高	169,920	171,925	177,139	167,220	163,362
											うち無担	136,881	138,718	145,004	135,534	132,054
											うちO/N	69,339	71,056	77,942	69,762	68,632
											うち有担	33,039	33,207	32,135	31,686	31,308

●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)
国庫短期証券	1128	-	35,000	2022/12/20	2023/12/20	79,228.0	29,273.9	100.0450	▲0.0449%	32.1904%	100.0650	▲0.0649%	5,726.0

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>		2022/12/20	2023/1/11		4,660	4,660				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/12/20			7,123	4,753	0.010		0.013	58.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/12/20			8,451	4,755	0.017		0.019	89.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/12/20			10,123	5,503	▲0.001		0.008	5.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2022/12/20			4,432	2,505	0.035		0.038	69.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/12/19	2022/12/20	▲ 0.350	19,780	19,780		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/19	2022/12/20	▲ 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		2022/12/20		0.000	12,737	12,737				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/20		0.030	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		2022/12/20		0.020	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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20日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)	*11月の米住宅着工件数
*日銀総裁定例会見	
◆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	