

Central Daily Market Report

2022年12月22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22日 需給速報	2022年12月23日 需給予想	2022年12月26日 当社予想			
銀行券	▲ 3,900	▲ 2,500	▲ 2,000			
財政	7,200	8,200	▲ 2,500			
資金過不足	3,300	5,700	▲ 4,500			
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	2,000	13,300				
CP等買入		▲ 300	▲ 1,000			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			▲ 3,200			
被災地支援 社債等買入		▲ 100	▲ 100			
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			8,400	▲ 11,900		
ETF買入						
国債補完供給	▲ 33,000	37,900	33,000			
当増減	10,800	44,200	▲ 4,500			
当座預金残高	5,003,800	5,048,000	5,043,500			
準備預金残高	4,362,800					
積み終了先	4,359,000			12月23日以降の残り所要積立額 積数	16,000	
超過準備	4,358,700			1日平均	700	
非準備預金先	641,000					
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	99.59%	日数	22.58%		

●2022年12月22日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、邦銀・外銀業態からの調達を中心に▲0.085～▲0.05%近辺での出会いとなった。レート水準を上昇させて調達する先も一部に見られたが、大方の先は前日と同水準での取引となった。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、▲0.13～▲0.10%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＞

22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発行市場は大型案件を含め複数の業態から発行が見られた。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

2022/12/22	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	▲ 0.065				-	▲ 0.091	0.390	▲ 0.088	26,507.87	120.15	132.39-41	131.95-97
T/N							-	▲ 0.118						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.073	▲ 0.005	▲ 0.063				-	▲ 0.129						
2W							-	▲ 0.209						
3W			0.001				-	▲ 0.182						
1M			0.005				-	▲ 0.176						
3M							▲ 0.180	▲ 0.145						
6M							▲ 0.128	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.109						
									日付	12/15	12/16	12/19	12/20	12/21
									日銀当預残	4,874,200	4,890,600	4,888,600	4,993,300	4,993,000
									準備預金残	4,307,300	4,285,200	4,287,500	4,380,400	4,377,500
									マネタリーベース	6,149,700	6,167,500	6,167,400	6,274,700	6,276,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.072%	▲ 0.071%	▲ 0.068%	▲ 0.067%
									コール市場残高	167,220	163,362	158,208	161,963	168,015
									うち無担	135,534	132,054	127,851	131,220	137,446
									うちO/N	69,762	68,632	63,049	64,669	68,815
									うち有担	31,686	31,308	30,357	30,743	30,569

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	6,500	2022/12/23			11,153	6,502	▲0.049		▲0.025	47.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2022/12/23			13,766	6,753	▲0.107		▲0.082	86.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/12/22	2022/12/23	▲ 0.350	33,476	33,476		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/22	2022/12/23	▲ 0.350	1	1		▲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		2022/12/23		0.022	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/23		0.055	0	0				

*オへの種類が、国債売現先(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、0.500%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)
新型コロナウイルス対応金融支援特別 制度融資分	2022/12/23	2023/3/31	0	7,391
新型コロナウイルス対応金融支援特別 プロパー融資分	2022/12/23	2023/3/31	0	967

(参考) 2022/12/23時点の貸出残高 (億円)	
制度融資分	43,162
プロパー融資分	60,785
合計	103,947

●2022年12月23日の予定

*11月の全国消費者物価指数(CPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.7%)
*金融政策決定会合議事要旨(10月27・28日分)

*11月の米耐久財新規受注
*11月の米個人所得・消費支出
*11月の米新築一戸建て販売件数

◆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