

Central Daily Market Report

2022年12月26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26日 需給速報	2022年12月27日 需給予想	2022年12月28日 当社予想			
銀行券	▲ 2,600	▲ 2,600	▲ 3,000			
財政	4,400	200	5,000			
資金過不足	1,800	▲ 2,400	2,000			
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						
国債買入			18,100			
CP等買入		▲ 900		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
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						
国債補完供給	▲ 27,800	30,600		27,800		
当増減	3,700	43,000		2,000		
当座預金残高	5,021,900	5,064,900		5,066,900		
準備預金残高	4,375,300					
積み終了先	4,373,900				12月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,373,900				積数	8,600
非準備預金先	646,600				1日平均	400
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	99.78%		日数		35.48%

●2022年12月26日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.075~▲0.06%程度の調達で始まった。週末要因剥落により、調達サイドのニーズが減退した事で、出合いの水準も前営業日比でやや低下となった。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.125~▲0.09%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>

26日のアウトライト市場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

2022/12/26	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	▲ 0.062				-	▲ 0.091	0.440	0.065	26,405.87	170.62	132.79-90	132.65-81
T/N							-	▲ 0.122						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.209						
2W			0.010				-	▲ 0.191						
3W							-	▲ 0.178						
1M							-	▲ 0.172						
3M			0.480				▲ 0.180	▲ 0.147						
6M							▲ 0.128	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.106						
									日付	12/19	12/20	12/21	12/22	12/23
									日銀当預残	4,888,600	4,993,300	4,993,000	5,003,800	5,018,200
									準備預金残	4,287,500	4,380,400	4,377,500	4,363,400	4,381,400
									マネタリーベース	6,167,400	6,274,700	6,276,800	6,291,400	6,308,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.071%	▲ 0.068%	▲ 0.067%	▲ 0.065%	▲ 0.062%
									コール市場残高	158,208	161,963	168,015	173,530	181,699
									うち無担	127,851	131,220	137,446	142,924	151,187
									うちO/N	63,049	64,669	68,815	73,694	78,927
									うち有担	30,357	30,743	30,569	30,606	30,512

●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	募入最高利回り	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	第1非価格競争入札(億円)
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)	5,750	2022/12/27			9,269	5,752	▲0.012		▲0.007	50.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2022/12/27			21,468	6,752	▲0.021		▲0.009	58.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2022/12/27			4,684	3,003	▲0.025		▲0.015	86.6
国債買入(残存期間25年超)	2,000	2022/12/27			3,124	2,001	▲0.055		▲0.040	58.5
国債買入(物価連動債)	600	2022/12/27			1,548	600	▲0.200		▲0.439	52.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/12/26	2022/12/27	▲ 0.350	27,999	27,999		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/26	2022/12/27	▲ 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		2022/12/27		0.125	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		2022/12/27		0.105	0	0				

●2022年12月27日の予定

*11月の完全失業率(市場予想: 2.5%)	*11月の商業動態統計速報	*London祝日(Christmas Day, substitute)	*2年利付国債入札
*11月の有効求人倍率(市場予想: 1.36倍)	*11月の住宅着工統計	*10月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	(29,000億円、1/4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