Central Daily Market Report

2022年12月28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28日 需給速報		2022年12月29日 需給予想		2022年12月30日 当社予想	
銀行券	▲ 2,500		▲ 2,100		▲ 3,000	
財政	100		▲ 7,600		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 2,400		▲ 9,700		▲ 6,000	
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			6,500			
CP等買入		▲ 1,400		▲ 200	4,000	
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 26,100	28,900		26,100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,000		22,700		▲ 2,000	

当座預金残高	5,035,300	5,058,000	5,056,000
準備預金残高	4,408,800		
積み終了先	4,407,400		
超過準備	4,407,400		
非準備預金先	626,500		

12月29日以降の残り所要積立額	
積数	5,700
1日平均	300

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	99.85%	日数 41.94%

●2022年12月28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▲0.06～▲0.045%程度の調達で始まった。引き続き大手行を中心に調達ニーズが強く、レート目線を引き上げる先が散見されたことで、出合いの水準は前日比で上昇となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10～▲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>

28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

2022/12/28	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.047				－	▲ 0.089
T/N							－	▲ 0.092
S/N			▲ 0.020				－	－
1W	0.000	0.001	0.001				－	▲ 0.183
2W			0.010				－	▲ 0.172
3W							－	▲ 0.159
1M							－	▲ 0.154
3M							▲ 0.180	▲ 0.147
6M							▲ 0.128	▲ 0.126
1Y							▲ 0.065	▲ 0.103

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）
0.450	▲ 0.009	26,340.50	▲ 107.37	133.48-50	133.91-93

日付	12/21	12/22	12/23	12/26	12/27
日銀当預残	4,993,000	5,003,800	5,018,200	5,021,900	5,036,300
準備預金残	4,377,500	4,363,400	4,381,400	4,375,300	4,409,300
マネタリーベース	6,276,800	6,291,400	6,308,300	6,314,700	6,331,600
無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.065%	▲0.062%	▲0.062%	▲0.053%
コール市場残高	168,015	173,530	181,699	176,254	181,309
うち無担	137,446	142,924	151,187	146,660	154,403
うちO/N	68,815	73,694	78,927	72,950	80,973
うち有担	30,569	30,606	30,512	29,594	26,906

●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1年超3年以下）	1,000	2022/12/29			5,110	1,000		0.016	0.016	
国債買入（残存期間3年超5年以下）	1,000	2022/12/29			3,337	1,002	▲0.002		0.000	72.4
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,000	2022/12/29			13,304	3,003	▲0.002		0.003	45.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/12/28	2022/12/29	▲ 0.350	26,495	26,495		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/28	2022/12/29	▲ 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		2022/12/29		0.041	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		2022/12/29		0.050	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間1年超3年以下）※3		2022/12/29		0.000	375	375				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間3年超5年以下）※4		2022/12/29		0.000	1,208	1,208				

*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、0.500%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358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。※3固定利回較差の結果、2年利付国債443回の買入利回りは、0.030%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※4固定利回較差の結果、5年利付国債154回の買入利回りは、0.240%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年12月29日の予定

*特にありません

◆本資料は信頼できると思わ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。
◆本資料は何ら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論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