

# Central Daily Market Report

2021年12月16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	2021年12月16日		2021年12月17日		2021年12月20日	
	需給速報		需給予想		当社予想	
銀行券	▲ 3,300		▲ 2,400		▲ 2,000	
財政	0		▲ 2,600		80,000	
資金過不足	▲ 3,300		▲ 5,000		78,000	
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		▲ 43,700				
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	13,800					
CP等買入		▲ 500	5,000	▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 200	300		200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 33,700		▲ 600		78,000	
当座預金残高	5,307,600		5,307,000		5,385,000	
準備預金残高	4,693,700					
積み終了先	3,527,500		12月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	1,373,800		積数		449,400	
非準備預金先	613,900		1日平均		15,000	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,769,300	
準備預金進捗率	実績	88.08%	日数	3.23%		

## ●2021年12月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み初日となる中、各業態の資金調達需要は落ち着いており、昨日より低い水準での取引が中心となった。立ち上がりは、邦銀・外銀業態などから▲0.055~▲0.01%の水準で調達が見られた。一巡後は、▲0.06~▲0.025%のレンジの出合いで推移した。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、▲0.085~▲0.080%程度での出合い。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>

16日はTB3M物(1047回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。この他に、1Y物と6M物にも出合いが見られた。

### <CP市場>

CP市場は、複数の業態から入札が実施された。発行レートは、期末越えのターム物において引き続き低位で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2021/12/16	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.086	0.040	▲ 0.005	29,066.32	606.60	114.14-15	114.11-12
T/N	▲ 0.055	▲ 0.010	▲ 0.036				-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.023	▲ 0.020	▲ 0.021				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.045	▲ 0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.101						
1M			0.012				-	▲ 0.103						
3M							▲ 0.118	▲ 0.111						
6M							▲ 0.120	▲ 0.121						
1Y							▲ 0.117	▲ 0.133						
									日付	12/9	12/10	12/13	12/14	12/15
									日銀当預残	5,259,100	5,230,900	5,239,100	5,251,900	5,341,300
									準備預金残	4,679,000	4,697,300	4,654,700	4,665,200	4,753,200
									マネタリーベース	6,494,600	6,467,400	6,476,800	6,491,700	6,583,300
									無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.008%	▲0.009%	▲0.014%	▲0.022%
									コール市場残高	165,954	175,343	154,740	163,780	160,027
									うち無担	148,090	154,891	136,932	145,813	141,874
									うちO/N	66,662	73,303	60,479	72,310	68,846
									うち有担	17,864	20,452	17,808	17,967	18,153

## ●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	1047	-	43,000	2021/12/20	2022/3/28	156,364.0	34,980.5	100.0295	▲0.1098%	77.3480%	100.0303	▲0.1128%	8,019.0
20年利付国債	178	0.500%	12,000	2021/12/17	2041/9/20	36,232.0	9,906.00	100.8000	0.4550%	73.0359%	100.8600	0.4520%	2,086.0

## ●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)		2021/12/16	2021/12/17	▲0.350	224	224		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/16	2021/12/17	▲0.350	0	0				

## ●2021年12月17日の予定

\*日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)  
\*黒田日銀総裁、定例会見  
\*10月の石油等消費動態統計

\*ユーロ圏11月の消費者物価指数改定値

◆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