

# Central Daily Market Report

2021年12月28日(火)

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28日 需給速報	2021年12月29日 需給予想	2021年12月30日 当社予想
銀行券	▲ 3,100	▲ 2,200	▲ 700
財政	▲ 1,200	▲ 4,700	▲ 4,200
資金過不足	▲ 4,300	▲ 6,900	▲ 4,900
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			▲ 15,200
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入	▲ 1,300		5,000
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	▲ 200	200	200
*ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 5,600	▲ 6,700	▲ 15,100
当座預金残高	5,457,100	5,450,400	5,435,300
準備預金残高	4,852,100		
積み終了先	4,851,700		12月29日以降の残り所要積立額
超過準備	4,851,700		積数 1,500
非準備預金先	605,000		1日平均 100
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	99.96%	日数 41.94%

## ●2021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▲0.05~▲0.008%の調達で始まった。引き続き調達ニーズは強く、前日比でレート水準は上昇した。一巡後は▲0.045~▲0.01%程度の出合いが数件見られ、本日の取引を終えた。ターム物は年明けスタート物を中心に引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.075%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>

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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2021/12/28	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)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.077	0.060	0.000	29,069.16	392.70	114.78-80	114.84-85
T/N	▲ 0.028	0.001	▲ 0.012				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W			0.001				-	▲ 0.085						
2W			▲ 0.045				-	▲ 0.087						
3W			▲ 0.023				-	▲ 0.091						
1M			▲ 0.018				-	▲ 0.094						
3M							▲ 0.122	▲ 0.107						
6M			0.020				▲ 0.115	▲ 0.119						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.130						
									日付	12/21	12/22	12/23	12/24	12/27
									日銀当預残	5,368,600	5,384,000	5,382,500	5,404,300	5,462,700
									準備預金残	4,736,500	4,753,000	4,756,800	4,798,400	4,856,300
									マネタリーベース	6,620,900	6,638,900	6,641,500	6,666,200	6,727,500
									無担O/N加重平均	▲0.028%	▲0.028%	▲0.027%	▲0.023%	▲0.021%
									コール市場残高	198,246	200,593	199,560	195,397	182,439
									うち無担	180,445	183,000	181,088	177,732	164,741
									うちO/N	102,062	102,817	100,485	96,759	83,328
									うち有担	17,801	17,593	18,472	17,665	17,698

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2021/12/28	2021/12/29	▲ 0.350	165	165		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2021/12/28	2021/12/29	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2021/12/30	2022/1/6	0.320	0	0				

## ●2021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