Central Daily Market Report

2022年12月6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	2022年12月6日 需給速報		2022年12月7日 需給予想		2022年12月8日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,300		▲ 2,500	
財政	1,000		▲ 9,200		4,000	
資金過不足	500		▲ 10,500		1,500	
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			1,500	▲ 1,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	700		1,000			
CP等買入				▲ 200		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
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	▲ 12,300	9,600		12,300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,500		3,400		1,500	

当座預金残高	4,804,700	4,808,100	4,809,600
準備預金残高	4,176,200		
積み終了先	4,175,900	12月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,175,900	積数	2,500
非準備預金先	628,500	1日平均	300
積み期間（11/16～12/15）の所要準備額			3,767,900
準備預金進捗率	実績 99.93%	日数	70.00%

●2022年12月6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▲0.087～▲0.077%程度の調達で始まった。今週に入りビッド数は僅かに増加傾向で推移しているが、レートへの影響は限定的で、前日とほぼ同水準での出合いとなった。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、▲0.10～▲0.095%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>

6日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱めの結果となった。マーケットで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発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●2022年12月7日の予定

*長野県金融経済懇談会において中村日銀審議委員講演
*11月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*10月の景気動向指数速報
*10月の米消費者信用残高
*7-9月期のユーロ圏GDP確報値

●短期金融市場関連指標

2022/12/6	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.078				－	▲ 0.099
T/N							－	▲ 0.101
S/N							－	－
1W	▲ 0.075	▲ 0.069	▲ 0.074				－	▲ 0.114
2W							－	▲ 0.120
3W			0.050				－	▲ 0.126
1M							－	▲ 0.152
3M							▲ 0.170	▲ 0.139
6M							▲ 0.130	▲ 0.131
1Y							▲ 0.110	▲ 0.128

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）
0.250	0.000	27,885.87	65.47	136.55-57	136.94-95

日付	11/29	11/30	12/1	12/2	12/5
日銀当預残	4,939,700	4,941,100	4,887,500	4,794,300	4,806,200
準備預金残	4,271,200	4,293,000	4,232,000	4,150,600	4,175,500
マネタリーベース	6,197,100	6,199,200	6,146,600	6,054,000	6,066,900
無担O/N加重平均	▲0.078%	▲0.079%	▲0.079%	▲0.078%	▲0.078%
コール市場残高	158,945	155,729	158,734	155,567	162,776
うち無担	129,595	127,406	128,300	124,439	130,919
うちO/N	62,393	64,954	61,488	57,627	64,797
うち有担	29,350	28,323	30,434	31,128	31,857

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	76	1.40%	9,000	2022/12/7	2052/9/20	21,844.0	7,280.00	98.1500	**1.4890%**	**26.9014%**	98.3200	**1.4810%**	1,716.0	
交付税特会	－	－	13,000	2022/12/15	2023/6/15	461,321.0	12,990.06	－	**0.0000%**	**2.8159%**	－	**0.0000%**	－	10.00

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞		2022/12/7	2022/12/20		1,451	1,451				
国庫短期証券買入	1,000	2022/12/7			6,396	1,000		0.021	0.021	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/12/6	2022/12/7	▲ 0.350	12,219	12,219		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/6	2022/12/7	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/12/8	2022/12/15	4.090	1	1				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/12/7		0.000	990	990				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/12/7		0.045	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※3		2022/12/7		0.030	0	0				

*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、0.250%となる。買入金額に制限を設け
※2固定利回較差の結果、10年利付国債357回の買入利回りは、0.250%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、10年利付国債358回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

◆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