

# Central Daily Market Report

2022年12月8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	2022年12月8日 需給速報		2022年12月9日 需給予想		2022年12月12日 当社予想	
銀行券	▲ 2,900		▲ 1,400		▲ 1,000	
財政	▲ 2,000		▲ 24,600		▲ 8,000	
資金過不足	▲ 4,900		▲ 26,000		▲ 9,000	
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	12,900		200			
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
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	▲ 12,200	11,100		12,200		
当預増減	6,800		▲ 14,400		▲ 9,000	
当座預金残高	4,800,000		4,785,600		4,776,600	
準備預金残高	4,184,000					
積み終了先	4,182,300		12月9日以降の残り所要積立額		積数 26,800	
超過準備	4,182,300		1日平均		3,800	
非準備預金先	616,000					
積み期間(11/16~12/15)の所要準備額					3,836,100	
準備預金進捗率	実績	99.30%	日数	76.67%		

## ●2022年12月8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%程度の調達となった。積み最終日に向けた調整から、取り手サイドのネームに出入りが見られるものの、全体の調達ニーズに大きな変化は無く、レートへの影響も限定的となっている。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~▲0.09%程度での出会い。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>

8日はTB6M物(第1125回)の入札が実施され、やや強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。この他、3M物でも出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。本日はCP等買入オペが事前予定通り4,000億円でおファーされた。結果は按分落札レート0.001%、平均落札レート0.013%と前回(按分落札レート0.001%・平均落札レート0.014%)比で按分は横這い、平均は低下となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/12/8	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.077				-	▲ 0.096	0.250	0.000	27,574.43	▲ 111.97	136.37-39	136.70-72		
T/N							-	▲ 0.101								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.078	▲ 0.070	▲ 0.076				-	▲ 0.109								
2W							-	▲ 0.118								
3W			▲ 0.073				-	▲ 0.123								
1M			0.020				-	▲ 0.153								
3M							▲ 0.170	▲ 0.138								
6M							▲ 0.145	▲ 0.130								
1Y							▲ 0.110	▲ 0.125								
											日付	12/1	12/2	12/5	12/6	12/7
											日銀当預残	4,887,500	4,794,300	4,806,200	4,804,700	4,793,200
											準備預金残	4,232,000	4,150,600	4,175,500	4,176,300	4,168,500
											マネタリーベース	6,146,600	6,054,000	6,066,900	6,065,900	6,055,700
											無担O/N加重平均	▲ 0.079%	▲ 0.078%	▲ 0.078%	▲ 0.078%	▲ 0.077%
											コール市場残高	158,734	155,567	162,776	159,493	162,441
											うち無担	128,300	124,439	130,919	128,223	131,784
											うちO/N	61,488	57,627	64,797	60,521	63,732
											うち有担	30,434	31,128	31,857	31,270	30,657

## ●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	1125	-	40,000	2022/12/12	2023/6/12	134,170.0	32,649.8	100.0580	▲0.1162%	33.4036%	100.0660	▲0.1322%	7,350.0
5年利付国債	154	0.10%	25,000	2022/12/9	2027/9/20	72,685.0	20,309.0	99.8800	0.1250%	18.5385%	99.9000	0.1210%	4,685.0
エネルギー対策	-	-	6,800	2022/12/20	2023/12/20	148,506.0	6,799.81	-	0.0000%	4.5789%	-	0.0000%	-

## ●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)		2022/12/8	2022/12/9	▲ 0.350	12,107	12,107		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/8	2022/12/9	▲ 0.350	0	0				
CP等買入	4,000	2022/12/13			9,210	3,970	0.001		0.013	8.3
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/12/9		0.000	201	201				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/12/9		0.065	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		2022/12/9		0.046	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。

## ●2022年12月9日の予定

*11月のマネーストック	*11月の米生産者物価指数	*国庫短期証券(1126回)入札
*10月の特定サービス産業動態統計速報	*10月の米卸売売上高	(3ヶ月、60,000億円、12/12発行)
	*12月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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