Central Daily Market Report

2022年12月16日（金）
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16日 需給速報		2022年12月19日 需給予想		2022年12月20日 当社予想	
銀行券	▲ 1,400		▲ 1,900		▲ 5,000	
財政	20,200		▲ 1,300		86,500	
資金過不足	18,800		▲ 3,200		81,500	
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	3,000		1,400			
CP等買入		▲ 800		▲ 100		
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		▲ 100	1,000	
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	▲ 17,900	13,400		17,900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	16,400		15,900		81,000	

当座預金残高	4,890,600	4,906,500	4,987,500
準備預金残高	4,284,000		
積み終了先	4,255,800	12月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	2,998,200	積数	47,400
非準備預金先	606,600	1日平均	1,700
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 98.79%	日数	9.68%

●2022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は、邦銀・外銀業態からの調達を中心に▲0.08～▲0.06%近辺での出合いとなった。新積み期間初日かつ3日積みとなった事で、レート目線が定まりづらい状況であったが、基準比率が44.0%から46.5%に上昇した影響もあり、積極的な調達意欲を見せる参加者も散見され、前積み期間の序盤に比べやや高い水準での取引も多く見られた。
ターム物はショートタームで▲0.075～▲0.065%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09～▲0.07%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>

16日はTB3M物（第1127回）の入札が実施され、テールが流れる弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。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

2022/12/16	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	▲ 0.072				－	▲ 0.086
T/N							－	▲ 0.089
S/N							－	－
1W			▲ 0.068				－	▲ 0.100
2W	▲ 0.075	▲ 0.033	▲ 0.071				－	▲ 0.158
3W							－	▲ 0.154
1M			0.140				－	▲ 0.149
3M			0.000				▲ 0.153	▲ 0.140
6M							▲ 0.150	▲ 0.130
1Y							▲ 0.112	▲ 0.126

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	27,527.12	▲ 524.58	137.75-77	137.22-24

日付	12/9	12/12	12/13	12/14	12/15
日銀当預残	4,773,300	4,756,100	4,762,100	4,788,400	4,874,200
準備預金残	4,160,100	4,159,100	4,203,800	4,236,500	4,307,300
マネタリーベース	6,040,200	6,024,000	6,032,200	6,060,900	6,149,700
無担O/N加重平均	▲0.077%	▲0.077%	▲0.075%	▲0.068%	▲0.064%
コール市場残高	167,289	169,920	171,925	177,139	167,220
うち無担	136,932	136,881	138,718	145,004	135,534
うちO/N	68,890	69,339	71,056	77,942	69,762
うち有担	30,357	33,039	33,207	32,135	31,686

●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)
国庫短期証券	1127	－	60,000	2022/12/19	2023/3/27	108,867.0	48,729.9	100.0355	▲0.1321%	80.1818%	100.0481	▲0.1790%	11,270.0

●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）		2022/12/16	2022/12/19	▲ 0.350	17,750	17,750		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/16	2022/12/19	▲ 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		2022/12/19		0.000	1,425	1,425				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/12/19		0.030	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		2022/12/19		0.020	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ずオファー。
※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19日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合（1日目、20日まで）
*7-9月期の資金循環統計速報
*国庫短期証券（1128回）入札
（1年、35,000億円、12/20発行）

◆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