Central Daily Market Report

2022年12月21日（水）
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21日 需給速報		2022年12月22日 需給予想		2022年12月23日 当社予想	
銀行券	▲ 2,400		▲ 3,800		▲ 3,000	
財政	▲ 5,700		4,800		5,000	
資金過不足	▲ 8,100		1,000		2,000	
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			1,000			
国債買入	19,200		2,000			
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
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						▲ 11,900
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 37,900	26,700		37,900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 300		41,500		▲ 9,900	

当座預金残高	4,993,000	5,034,500	5,024,600
準備預金残高	4,377,400		
積み終了先	4,372,700	12月22日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,372,500	積数	20,200
非準備預金先	615,600	1日平均	800
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 99.48%	日数	19.35%

●2022年12月21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・証券業態からの調達を中心に▲0.085～▲0.05%近辺での出合いとなった。前日に日銀からYCCの運用見直しが発表されたが、コール市場への影響は限定的となっており、レート水準は概ね横這いからやや上昇した程度での推移となった。ターム物はショートタームで▲0.07%近辺の出合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.13～▲0.085%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>

21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、無難な結果となった。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発行市場は複数の業態で発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/12/21	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	▲ 0.067				－	▲ 0.099
T/N							－	▲ 0.129
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.131
2W							－	▲ 0.204
3W							－	▲ 0.178
1M							－	▲ 0.171
3M							▲ 0.180	▲ 0.143
6M							▲ 0.128	▲ 0.130
1Y							▲ 0.065	▲ 0.112

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）
0.478	0.068	26,387.72	▲ 180.31	131.88-90	131.75-78

日付	12/14	12/15	12/16	12/19	12/20
日銀当預残	4,788,400	4,874,200	4,890,600	4,888,600	4,993,300
準備預金残	4,236,500	4,307,300	4,285,200	4,287,500	4,380,400
マネタリーベース	6,060,900	6,149,700	6,167,500	6,167,400	6,274,700
無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.064%	▲0.072%	▲0.071%	▲0.068%
コール市場残高	177,139	167,220	163,362	158,208	161,963
うち無担	145,004	135,534	132,054	127,851	131,220
うちO/N	77,942	69,762	68,632	63,049	64,669
うち有担	32,135	31,686	31,308	30,357	30,743

●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)
流動性供給	372	－	5,000	2022/12/22		14,415.0	4,995.0		0.0270%	75.2021%		0.0220%	

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/12/22			7,474	1,000	0.006		0.008	27.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	1,000	2022/12/22			4,166	1,000		0.062	0.064	
国債買入（残存期間5年超10年以下）	1,000	2022/12/22			5,332	1,002	0.051		0.055	85.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/12/21	2022/12/22	▲ 0.350	38,060	38,060		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/21	2022/12/22	▲ 0.350	117	117		▲0.350	▲0.350	
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/12/22		0.090	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/12/22		0.115	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、0.500%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358回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年12月22日の予定

*10月の景気動向指数改訂状況
*7-9月期の米GDP確報値
*12月の米CB消費者信頼感指数
*7-9月期の英GDP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