Central Daily Market Report

2022年12月23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23日 需給速報		2022年12月26日 需給予想		2022年12月27日 当社予想	
銀行券	▲ 2,500		▲ 2,700		▲ 5,000	
財政	9,000		4,800		10,000	
資金過不足	6,500		2,100		5,000	
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	13,300					
CP等買入		▲ 1,000		▲ 900		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）		▲ 3,200				
被災地支援						
社債等買入		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別	8,400	▲ 11,900				
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 30,600	33,000		30,600		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	14,400		31,800		5,000	

当座預金残高	5,018,200	5,050,000	5,055,000
準備預金残高	4,383,500		
積み終了先	4,381,800	12月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,381,500	積数	10,000
非準備預金先	634,700	1日平均	500
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 99.74%	日数	32.26%

●2022年12月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀・外銀業態からの調達を中心に▲0.08～▲0.055%近辺での出合いとなった。3日積みとなった事で全般的にレート水準を上昇させて調達する展開となった。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、▲0.13～▲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>

23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発行市場は大型案件を含め複数の業態から発行が見られた。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

2022/12/23	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	▲ 0.062				－	▲ 0.094
T/N							－	▲ 0.123
S/N							－	－
1W	▲ 0.070	▲ 0.060	▲ 0.067				－	▲ 0.216
2W							－	▲ 0.194
3W			▲ 0.034				－	▲ 0.180
1M							－	▲ 0.176
3M							▲ 0.180	▲ 0.146
6M							▲ 0.128	▲ 0.129
1Y							▲ 0.065	▲ 0.105

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）
0.375	▲ 0.015	26,235.25	▲ 272.62	132.36-40	132.52-54

日付	12/16	12/19	12/20	12/21	12/22
日銀当預残	4,890,600	4,888,600	4,993,300	4,993,000	5,003,800
準備預金残	4,285,200	4,287,500	4,380,400	4,377,500	4,363,400
マネタリーベース	6,167,500	6,167,400	6,274,700	6,276,800	6,291,400
無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.071%	▲0.068%	▲0.067%	▲0.065%
コール市場残高	163,362	158,208	161,963	168,015	173,530
うち無担	132,054	127,851	131,220	137,446	142,924
うちO/N	68,632	63,049	64,669	68,815	73,694
うち有担	31,308	30,357	30,743	30,569	30,606

●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Ｉ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）		2022/12/23	2022/12/26	▲ 0.350	30,848	30,848		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/23	2022/12/26	▲ 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		2022/12/26		0.110	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		2022/12/26		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26日の予定

*日本経済団体連合会審議員会において黒田日銀総裁講演
*11月の企業向けサービス価格指数
*New York祝日（Christmas Day, observed）
*EURO祝日（Christmas Holiday）
*London祝日（Boxing Day）

◆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