Central Daily Market Report

2022年12月27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27日 需給速報		2022年12月28日 需給予想		2022年12月29日 当社予想	
銀行券	▲ 2,600		▲ 2,400		▲ 4,000	
財政	500		▲ 500		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 2,900		▲ 11,000	
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	18,100					
CP等買入		▲ 500		▲ 1,400		
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	▲ 28,900	27,800		28,900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	14,400		24,600		▲ 11,000	

当座預金残高	5,036,300	5,060,900	5,049,900
準備預金残高	4,409,000		
積み終了先	4,407,500	12月28日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,407,500	積数	7,000
非準備預金先	627,300	1日平均	400
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 99.82%	日数	38.71%

●2022年12月27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▲0.065～▲0.05%程度の調達で始まった。大手行を中心に取り上がる動きが見られたことで、出合いの水準は前日比で上昇となった。ターム物は目立った出合いは見られなかった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.115～▲0.09%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>

27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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。
CP等買入オペが、事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.002%、平均レート0.012%と 前回(按分0.001%、平均0.013%)比で、按分は若干上昇、平均は若干低下となった。

●短期金融市場関連指標

2022/12/27	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				－	▲ 0.089
T/N							－	▲ 0.095
S/N							－	－
1W	0.001	0.008	0.002				－	▲ 0.192
2W			▲ 0.065				－	▲ 0.179
3W							－	▲ 0.166
1M							－	▲ 0.159
3M							▲ 0.180	▲ 0.149
6M							▲ 0.128	▲ 0.129
1Y							▲ 0.065	▲ 0.103

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）
0.459	0.019	26,447.87	42.00	132.75-77	132.87-89

日付	12/20	12/21	12/22	12/23	12/26
日銀当預残	4,993,300	4,993,000	5,003,800	5,018,200	5,021,900
準備預金残	4,380,400	4,377,500	4,363,400	4,381,400	4,375,300
マネタリーベース	6,274,700	6,276,800	6,291,400	6,308,300	6,314,700
無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.067%	▲0.065%	▲0.062%	▲0.062%
コール市場残高	161,963	168,015	173,530	181,699	176,254
うち無担	131,220	137,446	142,924	151,187	146,660
うちO/N	64,669	68,815	73,694	78,927	72,950
うち有担	30,743	30,569	30,606	30,512	29,594

●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)
2年利付国債	444	0.005%	29,000	2023/1/4	2025/1/1	91,733.0	24,277.0	99.9000	**0.0550%**	**11.0582%**	99.9240	**0.0430%**	4,718.0

●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）		2022/12/27	2022/12/28	▲ 0.350	29,238	29,238		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/27	2022/12/28	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/12/29	2023/1/12	4.590	0	0				
CP等買入	4,000	2022/12/30			8,820	4,000	0.002		0.012	46.9
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/12/28		0.060	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		2022/12/28		0.070	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28日の予定

*決定会合における主な意見（12月19・20日分）
*11月の鉱工業生産・出荷・在庫速報（市場予想：前月比▲0.3%）

◆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