Central Daily Market Report

2022年12月29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29日 需給速報		2022年12月30日 需給予想		2023年1月4日 当社予想	
銀行券	▲ 2,000		500		5,000	
財政	▲ 7,400		▲ 5,500		▲ 24,500	
資金過不足	▲ 9,400		▲ 5,000		▲ 19,500	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,500		6,600			
CP等買入		▲ 200	4,000	▲ 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	▲ 32,500	26,100		32,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 9,500		37,300		▲ 19,500	

当座預金残高	5,025,800	5,063,100	5,043,600
準備預金残高	4,417,900		
積み終了先	4,416,800		
超過準備	4,416,700		
非準備預金先	607,900		

12月30日以降の残り所要積立額	
積数	4,500
1日平均	300

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	99.88%	日数 45.16%

●2022年12月29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▲0.04～▲0.025%程度の調達で始まった。引き続き大手行を中心に調達ニーズが強く、出合いの水準は前日比で大幅に上昇する展開となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

年末初物となったGC T/Nは、▲0.18～▲0.10%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>

29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。

●短期金融市場関連指標

2022/12/29	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	▲ 0.033				－	▲ 0.091
T/N							－	▲ 0.153
S/N							－	－
1W			0.000				－	▲ 0.154
2W	▲ 0.070	▲ 0.050	▲ 0.067				－	▲ 0.147
3W							－	▲ 0.146
1M	▲ 0.050	0.000	▲ 0.025				－	▲ 0.142
3M			0.005				▲ 0.180	▲ 0.144
6M							▲ 0.128	▲ 0.127
1Y							▲ 0.065	▲ 0.101

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）
0.445	▲ 0.005	26,093.67	▲ 246.83	134.01-04	133.78-80

日付	12/22	12/23	12/26	12/27	12/28
日銀当預残	5,003,800	5,018,200	5,021,900	5,036,300	5,035,300
準備預金残	4,363,400	4,381,400	4,375,300	4,409,300	4,408,800
マネタリーベース	6,291,400	6,308,300	6,314,700	6,331,600	6,333,100
無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.062%	▲0.062%	▲0.053%	▲0.047%
コール市場残高	173,530	181,699	176,254	181,309	182,191
うち無担	142,924	151,187	146,660	154,403	153,163
うちO/N	73,694	78,927	72,950	80,973	80,383
うち有担	30,606	30,512	29,594	26,906	29,028

●入札結果

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
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/12/30		0.050	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		2022/12/30		0.045	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間1年超3年以下）※3		2022/12/30		0.000	460	460				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間3年超5年以下）※4		2022/12/30		0.000	74	74				
国債買入（残存期間1年超3年以下）	1,000	2022/12/30			5,203	1,000	0.017		0.019	50.0
国債買入（残存期間3年超5年以下）	1,000	2022/12/30			3,225	1,001	0.000		0.003	34.8
国債買入（残存期間5年超10年以下）	1,000	2022/12/30			5,492	1,009	0.013		0.015	63.0
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,000	2022/12/30			11,409	3,000	▲0.016		▲0.005	45.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/12/29	2022/12/30	▲0.350	33,009	33,009		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/12/29	2022/12/30	▲0.350	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。
※3固定利回較差の結果、2年利付国債443回の買入利回りは、0.030%となる。買入金額に制限を設けずオファー。※4固定利回較差の結果、5年利付国債154回の買入利回りは、0.240%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年12月30日の予定

*証券取引所大納会　　*12月のシカゴPM景況感指数

◆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