

# Central Daily Market Report

2022年12月30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30日 需給速報	2023年1月4日 需給予想	2023年1月5日 当社予想			
銀行券	700	2,600	5,500			
財政	▲ 8,300	▲ 26,200	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 7,600	▲ 23,600	▲ 1,500			
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	6,600	10,000				
CP等買入	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						
新型コロナウイルス対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 35,600	32,500	35,600			
※ドル資金供給用担保提供額						
当増減	▲ 900	22,000	▲ 1,500			
当座預金残高	5,024,900	5,046,900	5,045,400			
準備預金残高	4,425,700					
積み終了先	4,425,600			1月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,425,000			積数	800	
非準備預金先	599,200			1日平均	100	
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	99.98%	日数	61.29%		

## ●2022年12月30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▲0.035~▲0.015%程度の調達でまいった。年末を跨ぐ取引となり、調達を控える先も見られたが、全般としては大手行を中心に取り上がる展開となったことで、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、▲0.10~▲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>

30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。

## ●2023年1月3日の予定

\*11月の米建設支出

## ●2023年1月4日の予定

\*証券取引所大発会

\*12月のISM 製造業景況指数

## ●短期金融市場関連指標

2022/12/30	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円		
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.022					-	▲ 0.091	0.410	▲ 0.035	26,094.50	0.83	132.91-93	132.13-15
T/N								-	▲ 0.094						
S/N								-	-						
1W				0.000				-	▲ 0.110						
2W	▲ 0.055	▲ 0.027	▲ 0.038					-	▲ 0.116						
3W			▲ 0.040					-	▲ 0.122						
1M	▲ 0.030	0.120	0.020					-	▲ 0.129						
3M								▲ 0.180	▲ 0.138						
6M								▲ 0.128	▲ 0.123						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.101						
日付	12/23	12/26	12/27	12/28	12/29										
日銀当預残	5,018,200	5,021,900	5,036,300	5,035,300	5,025,800										
準備預金残	4,381,400	4,375,300	4,409,300	4,408,800	4,418,000										
マネタリーベース	6,308,300	6,314,700	6,331,600	6,333,100	6,325,700										
無担O/N加重平均	▲ 0.062%	▲ 0.062%	▲ 0.053%	▲ 0.047%	▲ 0.033%										
コール市場残高	181,699	176,254	181,309	182,191	181,377										
うち無担	151,187	146,660	154,403	153,163	153,422										
うちO/N	78,927	72,950	80,973	80,383	83,171										
うち有担	30,512	29,594	26,906	29,028	27,955										

## ●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		2023/1/4		0.052	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		2023/1/4		0.040	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		2023/1/4		0.000	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間3年超5年以下)※4		2023/1/4		0.000	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,000	2023/1/4			9,192	3,002	▲0.007		▲0.004	47.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	1,000	2023/1/4			2,855	1,000	▲0.032		▲0.025	8.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/1/4			11,445	3,001	▲0.038		▲0.032	92.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/1/4			5,276	3,001	▲0.088		▲0.059	89.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/12/30	2023/1/4	▲0.450	36,084	36,084		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/12/30	2023/1/4	▲0.450	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367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359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444回の買入利回りは、0.040%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。

本年も大変お世話になり、ありがとうございました。来年もよろしくお願い申し上げます。

◆本資料は信頼できるとさ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録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