

Central Daily Market Report

2022年10月3日(月)
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10月3日 需給速報	2022年10月4日 需給予想	2022年10月5日 当社予想			
銀行券	400	400	0			
財政	▲ 32,200	▲ 45,200	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 31,800	▲ 44,800	▲ 27,000			
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	12,700					
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
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	▲ 17,900	27,600		17,900		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 9,600	▲ 27,000		▲ 27,000		
当座預金残高	4,920,700	4,893,700		4,866,700		
準備預金残高	4,297,100					
積み終了先	4,296,800			10月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,296,800			積数	3,100	
非準備預金先	623,600			1日平均	300	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,750,600	
準備預金進捗率	実績	99.92%		日数	60.00%	

●2022年10月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、四半期末が通過し、再び資金調達を行う先が増加した事から、レート水準は前営業日に比べ上昇となった。朝方は、邦銀業態を中心に▲0.07~▲0.06%近辺での出合いが中心となり、一巡後も同水準での出合いが散見された。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>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.095%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>

3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発行市場は複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね幅広い圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/3	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.096	0.240	▲ 0.005	26,215.79	278.58	144.80-82	145.02-04
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.005	▲ 0.063				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.070	▲ 0.005	▲ 0.062				-	▲ 0.107						
3W							-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.069	0.000	▲ 0.038				-	▲ 0.128						
3M			0.005				▲ 0.275	▲ 0.150						
6M			0.008				▲ 0.235	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.144						
									日付	9/26	9/27	9/28	9/29	9/30
									日銀当預残	5,180,500	5,157,900	4,928,100	4,924,400	4,930,300
									準備預金残	4,543,700	4,514,700	4,294,500	4,290,300	4,326,300
									マネタリーベース	6,431,600	6,408,600	6,178,600	6,175,500	6,180,600
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.069%	▲0.068%	▲0.066%	▲0.073%
									コール市場残高	167,709	168,233	179,202	176,460	133,196
									うち無担	136,439	136,677	146,887	143,967	102,783
									うちO/N	69,092	68,430	80,190	78,260	64,030
									うち有担	31,270	31,556	32,315	32,493	30,413

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募種(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1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)		2022/10/3	2022/10/4	▲ 0.350	17,826	17,826		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/3	2022/10/4	▲ 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		2022/10/4		0.005	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		2022/10/4		0.035	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、0.250%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357回の買入利回りは、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2022年10月4日の予定

*9月のマネタリーベース	*8月の米製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札(27,000億円、10/5発行)
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み		*交付税特別会計借入(13,000億円、10/14借入)
*9月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+2.8%)		

◆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