

Central Daily Market Report

2022年10月4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10月4日 需給速報		2022年10月5日 需給予想		2022年10月6日 当社予想	
銀行券	300		▲ 200		▲ 500	
財政	▲ 43,100		▲ 30,100		4,000	
資金過不足	▲ 42,800		▲ 30,300		3,500	
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			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 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	▲ 15,900	17,900		15,900		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	▲ 40,900		▲ 13,500		3,500	
当座預金残高	4,879,800		4,866,300		4,869,800	
準備預金残高	4,243,200					
積み終了先	4,242,300		10月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,242,300		積数		2,100	
非準備預金先	636,600		1日平均		200	
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	99.94%	日数	63.33%		

●2022年10月4日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続きビッドサイドの調達ニーズが堅調な事から、レート水準は一段と上昇して推移した。朝方は、邦銀業態を中心に▲0.065~▲0.06%近辺での出会いが中心となり、一巡後も同水準での出会いが散見された。ターム物は、足元のレート上昇基調を受けて、一部の取り手からビッド目線を切り上げる動きが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.12~▲0.10%程度での出会いとなった。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>

4日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。また、マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出会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となった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/4	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	▲ 0.059				-	▲ 0.106	0.245	0.005	26,992.21	776.42	144.49-52	144.65-67
T/N							-	▲ 0.116						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.038	▲ 0.064				-	▲ 0.116						
2W	▲ 0.065	▲ 0.003	▲ 0.061				-	▲ 0.123						
3W							-	▲ 0.129						
1M							-	▲ 0.136						
3M							▲ 0.275	▲ 0.162						
6M							▲ 0.235	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.144						
									日付	9/27	9/28	9/29	9/30	10/3
									日銀当預残	5,157,900	4,928,100	4,924,400	4,930,300	4,920,700
									準備預金残	4,514,700	4,294,500	4,290,300	4,326,300	4,297,100
									マネタリーベース	6,408,600	6,178,600	6,175,500	6,180,600	6,170,500
									無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.068%	▲0.066%	▲0.073%	▲0.065%
									コール市場残高	168,233	179,202	176,460	133,196	170,551
									うち無担	136,677	146,887	143,967	102,783	140,224
									うちO/N	68,430	80,190	78,260	64,030	83,281
									うち有担	31,556	32,315	32,493	30,413	30,327

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	368	0.200%	27,000	2022/10/5	2032/9/20	121,840.0	21,947.0	99.5100	0.2500%	14.1495%	99.5300	0.2480%	5,037	3,115
交付税特会	-	-	13,000	2022/10/14	2023/4/14	410,494.0	12,990.21		0.0000%	3.1646%		0.0000%		10,000

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/10/5			5,078	1,000		0.003	0.004	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/4	2022/10/5	▲ 0.350	15,874	15,874		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/4	2022/10/5	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/10/6	2022/10/13	3.330	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		2022/10/5		0.010	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		2022/10/5		0.050	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5日の予定

*10月の日銀当座預金増減要因見込み	*9月のISM 非製造業景況指数
	*8月の米貿易収支

◆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