

Central Daily Market Report

2022年10月5日(水)
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5日 需給速報		2022年10月6日 需給予想		2022年10月7日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 800		1,000	
財政	▲ 30,200		2,600		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 30,300		1,800		▲ 4,000	
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	1,000					
国債買入			11,300			
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	▲ 16,100	15,900		16,100		
当預増減	▲ 29,600		29,100		▲ 4,000	
当座預金残高	4,850,200		4,879,300		4,875,300	
準備預金残高	4,211,300					
積み終了先	4,210,300		10月6日以降の残り所要積立額		積数 1,100	
超過準備	4,210,300		1日平均		100	
非準備預金先	638,900					
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 99.97%		日数 66.67%			

●2022年10月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き資金調達ニーズが堅調な事から、レート水準は上昇基調となっている。朝方は、邦銀業態を中心に▲0.058~▲0.05%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。ターム物に関しても、レート水準が上昇するなかショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.135~▲0.11%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>

5日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<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

2022/10/5	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.104	0.245	0.000	27,120.53	128.32	143.85-86	144.44-46		
T/N							-	▲ 0.129								
S/N							-	-								
1W							-	▲ 0.128								
2W			▲ 0.055				-	▲ 0.134								
3W							-	▲ 0.136								
1M	▲ 0.060	0.480	▲ 0.042				-	▲ 0.139								
3M							▲ 0.275	▲ 0.165								
6M							▲ 0.235	▲ 0.151								
1Y			0.163				▲ 0.145	▲ 0.144								
											日付	9/28	9/29	9/30	10/3	10/4
											日銀当預残	4,928,100	4,924,400	4,930,300	4,920,700	4,879,800
											準備預金残	4,294,500	4,290,300	4,326,300	4,297,100	4,242,700
											マネタリーベース	6,178,600	6,175,500	6,180,600	6,170,500	6,129,300
											無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.066%	▲0.073%	▲0.065%	▲0.059%
											ロール市場残高	179,202	176,460	133,196	170,551	164,802
											うち無担	146,887	143,967	102,783	140,224	132,827
											うちO/N	80,190	78,260	64,030	83,281	71,439
											うち有担	32,315	32,493	30,413	30,327	31,975

●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	募入最高利回り	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	第1非価格競争入札(億円)
<p>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。</p>													

●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(残存期間1年以下)	1,500	2022/10/6			1,813	1,500	▲0.090		▲0.020	17.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/10/6			17,045	4,752	▲0.006		▲0.006	94.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/10/6			11,900	4,753	▲0.006		▲0.004	68.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/5	2022/10/6	▲0.350	15,952	15,952		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/5	2022/10/6	▲0.350	10	10		▲0.350	▲0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/10/6		0.005	261	261				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/6		0.085	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回の募入利回りは、0.250%となる。募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回の募入利回りは、0.250%となる。募入金額に制限を設けずオファー。

●2022年10月6日の予定

*国庫短期証券(1112回)入札 (6ヶ月、40,000億円、10/11発行)	*流動性供給入札 (5,000億円、10/7発行)	*エネルギー対策借入 (6,500億円、10/20借入)
--	------------------------------	---------------------------------

◆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