

Central Daily Market Report

2022年10月7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10月7日 需給速報	2022年10月11日 需給予想	2022年10月12日 当社予想			
銀行券	▲ 200	600	▲ 1,000			
財政	▲ 6,700	▲ 11,800	2,000			
資金過不足	▲ 6,900	▲ 11,200	1,000			
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						▲ 11,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	300					
CP等買入	▲ 200	▲ 200				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 200	▲ 100			
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	▲ 15,000	17,100	15,000			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	▲ 4,900	3,500	▲ 10,300			
当座預金残高	4,854,600	4,858,100	4,847,800			
準備預金残高	4,230,600					
積み終了先	4,230,600			10月11日以降の残リ所要積立額		
超過準備	4,230,600			積数	100	
非準備預金先	624,000			1日平均	0	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額						3,744,800
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	83.33%		

●2022年10月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、3連休前の4日積みとなった事で、調達ニーズが非常に強く、レート水準は大きく上昇した。朝方は邦銀業態を中心に▲0.038~▲0.013%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見られた。ターム物については、引き続きショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.07%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>

7日はTB3M物(第1113回)の入札が実施され、弱めの結果となったが、結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<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

2022/10/7	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.086	0.245	0.000	27,116.11	▲ 195.19	145.03-06	144.90-92
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.025	▲ 0.048				-	▲ 0.094						
2W			▲ 0.060				-	▲ 0.106						
3W							-	▲ 0.116						
1M			▲ 0.060				-	▲ 0.126						
3M							▲ 0.165	▲ 0.161						
6M							▲ 0.161	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.144						
日付		9/30	10/3	10/4	10/5	10/6								
日銀当預残	4,930,300	4,920,700	4,879,800	4,850,200	4,859,500									
準備預金残	4,326,300	4,297,100	4,242,700	4,211,200	4,223,400									
マネタリーベース	6,180,600	6,170,500	6,129,300	6,099,900	6,109,900									
無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.065%	▲0.059%	▲0.052%	▲0.039%									
コール市場残高	133,196	170,551	164,802	183,193	190,779									
うち無担	102,783	140,224	132,827	150,944	158,611									
うちO/N	64,030	83,281	71,439	83,126	85,313									
うち有担	30,413	30,327	31,975	32,249	32,168									

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1113	-	60,000	2022/10/11	2023/1/16	119,690.0	48,645.70	100.0425	▲0.1598%	5.6319%	100.0505	▲0.1899%	11,354.0

●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)		2022/10/7	2022/10/11	▲ 0.350	14,952	14,952		▲ 0.350	▲ 0.354	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/7	2022/10/11	▲ 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		2022/10/11		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		2022/10/11		0.075	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、0.250%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10日の予定

*スポーツの日	*米国祝日(Columbus Day)
---------	---------------------

●2022年10月11日の予定

*8月の国際収支	*9月の景気ウオッチャー調査
----------	----------------

◆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