

Central Daily Market Report

2022年10月11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11日 需給速報		2022年10月12日 需給予想		2022年10月13日 当社予想	
銀行券	500		700		▲ 500	
財政	▲ 13,100		2,500		▲ 10,000	
資金過不足	▲ 12,600		3,200		▲ 10,500	
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			8,200	▲ 11,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			18,000			
国債買入						
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		▲ 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	▲ 16,400	15,000		16,400		
米ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	▲ 14,300		34,400		▲ 10,500	
当座預金残高	4,840,300		4,874,700		4,864,200	
準備預金残高	4,254,000					
積み終了先	4,254,000		10月12日以降の残り所要積立額		積数 0	
超過準備	4,254,000				1日平均 0	
非準備預金先	586,300				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	86.67%		

●2022年10月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、連休要因が剥落した事で、ビッド水準を引き下げる先が見られた一方で、引き続き調達意欲の強い先も多く見られた。立ち上がりは、邦銀業態を中心に▲0.02~▲0.018%近辺を中心に出会いが見られた。一巡後は、レート水準がやや低下し▲0.06~▲0.04%での出会いが散見された。ターム物は、積み期間の切り替わりを控え、様子見姿勢の先が多く、動意に乏しい展開となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.075%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>

11日のアウトライト市場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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/11	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	▲ 0.022				-	▲ 0.081	0.249	0.004	26,401.25	▲ 714.86	145.67-69	145.63-64
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.060				-	▲ 0.090						
2W			0.050				-	▲ 0.101						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.126						
3M							▲ 0.165	▲ 0.157						
6M							▲ 0.161	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.144						
									日付	10/3	10/4	10/5	10/6	10/7
									日銀当預残	4,920,700	4,879,800	4,850,200	4,859,500	4,854,600
									準備預金残	4,297,100	4,242,700	4,211,200	4,223,400	4,230,600
									マネタリーベース	6,170,500	6,129,300	6,099,900	6,109,900	6,105,300
									無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.059%	▲0.052%	▲0.039%	▲0.021%
									コール市場残高	170,551	164,802	183,193	190,779	191,890
									うち無担	140,224	132,827	150,944	158,611	159,973
									うちO/N	83,281	71,439	83,126	85,313	86,405
									うち有担	30,327	31,975	32,249	32,168	31,917

●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	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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>		2022/10/12	2022/10/26		8,150	8,150				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/10/12			15,432	4,755	0.006		0.007	66.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/10/12			8,509	4,754	0.008		0.010	9.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/10/12			11,359	5,502	0.005		0.012	23.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2022/10/12			5,341	2,514	0.028		0.029	87.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/11	2022/10/12	▲ 0.350	16,204	16,204		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/11	2022/10/12	▲ 0.350	102	102		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2022/10/13	2022/10/20	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		2022/10/12		0.005	350	350				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/12		0.055	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12日の予定

*8月の機械受注統計 (市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲2.3%)	*9月の米生産者物価指数	*30年利付国債入札 (9,000億円、10/13発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、10/24借入)
---	--------------	---------------------------------	----------------------------------

◆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