

Central Daily Market Report

2022年10月12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12日 需給速報	2022年10月13日 需給予想	2022年10月14日 当社予想			
銀行券	800	▲ 600	▲ 500			
財政	2,400	▲ 7,000	86,000			
資金過不足	3,200	▲ 7,600	85,500			
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			1,000			
国債買入	18,000					
CP等買入		▲ 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	16,400	15,900			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	18,500	9,200	85,500			
当座預金残高	4,858,800	4,868,000	4,953,500			
準備預金残高	4,273,400					
積み終了先	4,273,400			10月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,273,400			積数	0	
非準備預金先	585,400			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	90.00%		

●2022年10月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き地銀業態を中心に堅調な資金調達意欲が見られるものの、一部でビッド水準を引き下げる動きも見られた事で、全体としては若干低下となった。立ち上がりは、邦銀業態を中心に▲0.03~▲0.02%近辺で出合いが見られた。一巡後は、やや低下し▲0.06~▲0.03%で散発的な出合いが見られた程度で取引を終えた。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、▲0.085~▲0.075%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>

12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、弱めの結果となった。マーケットで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、五・十日の前倒し発行にあたり、複数の業態から大型発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。また、CP等買入オペが4,000億円オファーされ、按分落札率0.001%、平均落札率0.006%と、いずれも前回比で低下となった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/12	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考統計値	平均値	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	▲ 0.026					-	▲ 0.082	0.250	0.001	26,396.83	▲ 4.42	145.88-90	146.16-19
T/N								-	▲ 0.084						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.020	▲ 0.029					-	▲ 0.090						
2W								-	▲ 0.100						
3W								-	▲ 0.114						
1M	▲ 0.030	▲ 0.001	▲ 0.008					-	▲ 0.124						
3M			0.028					▲ 0.165	▲ 0.157						
6M								▲ 0.161	▲ 0.151						
1Y								▲ 0.145	▲ 0.144						
日付		10/4	10/5	10/6	10/7	10/11									
日銀当預残	4,879,800	4,850,200	4,859,500	4,854,600	4,840,300										
準備預金残	4,242,700	4,211,200	4,223,400	4,230,600	4,254,000										
マネタリーベース	6,129,300	6,099,900	6,109,900	6,105,300	6,090,400										
無担O/N加重平均	▲ 0.059%	▲ 0.052%	▲ 0.039%	▲ 0.021%	▲ 0.022%										
コール市場残高	164,802	183,193	190,779	191,890	170,705										
うち無担	132,827	150,944	158,611	159,973	139,552										
うちO/N	71,439	83,126	85,313	86,405	72,869										
うち有担	31,975	32,249	32,168	31,917	31,153										

●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1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	76	1.400%	9,000	2022/10/13	2052/9/20	20,945.0	7,256.0	98,0000	1.4960%	91.3793%	98.3200	1.4800%	1,741	
交付税特会	-	-	13,000	2022/10/24	2023/4/24	448,379.0	12,990.19	-	0.0000%	2.8972%	-	0.0000%	-	10.00

●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	2022/10/13			7,708	1,000	0.016		0.018	54.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/12	2022/10/13	▲ 0.350	15,891	15,891		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/12	2022/10/13	▲ 0.350	30	30		▲ 0.350	▲ 0.800	
CP等買入	4,000	2022/10/17			7,168	3,995	0.001		0.006	59.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/10/13		0.001	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		2022/10/13		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13日の予定

●9月の企業物価指数	●9月の米消費者物価指数
	●9月の米財政収支

◆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