

Central Daily Market Report

2022年10月13日(木)

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13日 需給速報		2022年10月14日 需給予想		2022年10月17日 当社予想	
銀行券	▲ 600		▲ 300		1,000	
財政	▲ 8,200		77,000		▲ 30,500	
資金過不足	▲ 8,800		76,700		▲ 29,500	
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			1,800			
CP等買入				▲ 300	4,000	
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 12,300	15,900		12,300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 4,300		90,500		▲ 25,500	
当座預金残高	4,854,500		4,945,000		4,919,500	
準備預金残高	4,238,500					
積み終了先	4,238,500		10月14日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	4,238,500				0	
非準備預金先	616,000				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	93.33%		

●2022年10月13日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、積み最終日を明日に控え、資金調達に目途が立つ先も多くなか、一部で資金運用に転ずる先もあった事から、出会い水準は若干低下となった。立ち上がりは、邦銀業態を中心に▲0.04~▲0.025%近辺で出会いが見られた。一巡後は、▲0.05~▲0.03%程度で散発的に出会いが見られた程度で取引を終えた。ターム物は、ショートターム物で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%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>

13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、複数の業態から大型発行が実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/13	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	▲ 0.033				-	▲ 0.115	0.245	▲ 0.005	26,237.42	▲ 159.41	146.77-79	146.83-84
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.050				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.063	▲ 0.005	▲ 0.058				-	▲ 0.100						
3W							-	▲ 0.114						
1M	▲ 0.065	0.040	▲ 0.047				-	▲ 0.124						
3M							▲ 0.165	▲ 0.156						
6M							▲ 0.161	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.144						
									日付	10/5	10/6	10/7	10/11	10/12
									日銀当預残	4,850,200	4,859,500	4,854,600	4,840,300	4,858,800
									準備預金残	4,211,200	4,223,400	4,230,600	4,254,000	4,273,400
									マネタリーベース	6,099,900	6,109,900	6,105,300	6,090,400	6,108,100
									無担O/N加重平均	▲ 0.052%	▲ 0.039%	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.026%
									コール市場残高	183,193	190,779	191,890	170,705	176,331
									うち無担	150,944	158,611	159,973	139,552	143,109
									うちO/N	83,126	85,313	86,405	72,869	77,906
									うち有担	32,249	32,168	31,917	31,153	33,222

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/13	2022/10/14	▲ 0.350	12,354	12,329		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/13	2022/10/14	▲ 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		2022/10/14		0.000	1,774	1,774				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/14		0.045	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14日の予定

*9月のマネーストック	*9月の米小売売上高 *8月の米企業在庫 *10月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(1114回)入札 (3ヶ月、60,000億円、10/17発行) *5年利付国債入札 (25,000億円、10/17発行)
-------------	---	---

◆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