

# Central Daily Market Report

2022年10月14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14日 需給速報		2022年10月17日 需給予想		2022年10月18日 当社予想	
銀行券	▲ 300		300		0	
財政	76,900		▲ 40,900		2,000	
資金過不足	76,600		▲ 40,600		2,000	
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						
国債買入	1,800		1,200			
CP等買入		▲ 300	4,000	▲ 500		
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 14,000	12,300		14,000		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	76,400		▲ 21,900		2,000	
当座預金残高	4,930,900		4,909,000		4,911,000	
準備預金残高	4,299,600					
積み終了先	4,299,600		10月17日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,299,600		積数		633,900	
非準備預金先	631,300		1日平均		21,100	
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,874,800	
準備預金進捗率	実績	83.64%	日数	3.23%		

## ●2022年10月14日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、実質的な積み最終日であると同時に、積み初日にもあたる事から、調達サイドは慎重な姿勢を取る先が多く、レート水準は低下する展開となった。立ち上がりは、邦銀業態を中心に▲0.06~▲0.04%近辺で出合いが見られた。一巡後は、▲0.08~▲0.05%程度で散發的な出合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>

14日はTB3M物(第1114回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかりと推移した。この他、6M物でも出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、案件が少なく閑散とした展開に終始した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/10/14	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.042				-	▲ 0.085	0.245	0.000	27,090.76	853.34	147.30-32	147.47-49
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W			0.008				-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.065	▲ 0.060	▲ 0.063				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.113						
1M							-	▲ 0.124						
3M							▲ 0.165	▲ 0.156						
6M							▲ 0.161	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.144						
									日付	10/6	10/7	10/11	10/12	10/13
									日銀当預残	4,859,500	4,854,600	4,840,300	4,858,800	4,854,500
									準備預金残	4,223,400	4,230,600	4,254,000	4,273,400	4,238,500
									マネタリーベース	6,109,900	6,105,300	6,090,400	6,108,100	6,104,400
									無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.021%	▲0.022%	▲0.026%	▲0.033%
									コール市場残高	190,779	191,890	170,705	176,331	180,238
									うち無担	158,611	159,973	139,552	143,109	149,608
									うちO/N	85,313	86,405	72,869	77,906	85,415
									うち有担	32,168	31,917	31,153	33,222	30,630

## ●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1114	-	60,000	2022/10/17	2023/1/23	147,942.0	48,640.7	100.0365	▲0.1358%	34.0350%	100.0406	▲0.1511%	11,359.0
5年利付国債	154	0.10%	25,000	2022/10/17	2027/9/20	81,089.0	20,310.0	100.0800	0.0830%	21.5292%	100.0900	0.0810%	4,683.0

## ●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)		2022/10/14	2022/10/17	▲ 0.350	14,012	14,012		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/14	2022/10/17	▲ 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		2022/10/17		0.005	1,184	1,184				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/17		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17日の予定

*8月の第3次産業活動指数
*8月の石油等消費動態統計

◆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