

Central Daily Market Report

2022年10月18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18日 需給速報		2022年10月19日 需給予想		2022年10月20日 当社予想	
銀行券	0		▲ 500		▲ 1,500	
財政	2,300		▲ 11,000		5,000	
資金過不足	2,300		▲ 11,500		3,500	
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	12,400		100			
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		▲ 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	▲ 11,700	13,400		11,700		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	16,100		1,100		3,500	
当座預金残高	4,911,500		4,912,600		4,916,100	
準備預金残高	4,273,300					
積み終了先	4,252,300		10月19日以降の残り所要積立額		積数 46,200	
超過準備	4,222,800				1日平均 1,700	
非準備預金先	638,200					
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	98.81%	日数	9.68%		

●2022年10月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、一部でビッド水準を引き上げる動きが見られたため、出合い水準は前日に比べて小幅に上昇する展開となった。立ち上がりは、邦銀業態を中心に▲0.07~▲0.06%近辺で出合いが見られた。一巡後は、出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。ターム物は、ショートターム物で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲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>

18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1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/18	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.084	0.250	0.000	27,156.14	380.35	148.96-98	148.95-97		
T/N							-	▲ 0.085								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.065	▲ 0.063	▲ 0.064				-	▲ 0.090								
2W	▲ 0.065	▲ 0.027	▲ 0.054				-	▲ 0.099								
3W							-	▲ 0.108								
1M	▲ 0.070	0.020	▲ 0.037				-	▲ 0.119								
3M							▲ 0.165	▲ 0.151								
6M							▲ 0.161	▲ 0.146								
1Y							▲ 0.140	▲ 0.142								
											日付	10/11	10/12	10/13	10/14	10/17
											日銀当預残	4,840,300	4,858,800	4,854,500	4,930,900	4,895,400
											準備預金残	4,254,000	4,273,400	4,238,500	4,299,600	4,262,200
											マネタリーベース	6,090,400	6,108,100	6,104,400	6,181,100	6,145,300
											無担O/N加重平均	▲ 0.022%	▲ 0.026%	▲ 0.033%	▲ 0.042%	▲ 0.065%
											コール市場残高	170,705	176,331	180,238	155,075	151,981
											うち無担	139,552	143,109	149,608	122,346	118,977
											うちO/N	72,869	77,906	85,415	63,463	60,761
											うち有担	31,153	33,222	30,630	32,729	33,004

●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	棄分率	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)
20年利付国債	182	1.100%	12,000	2022/10/19	2042/9/20	31,743.0	9,727.00	99,450.00	1.1330%	57.5980%	99.6200	1.1230%	2,265.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/10/19			7,814	1,000		0.031	0.036	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/18	2022/10/19	▲ 0.350	11,605	11,605		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/18	2022/10/19	▲ 0.350	100	100		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2022/10/20	2022/10/27	3.330	1	1				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/10/19		0.000	70	70				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/19		0.020	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19日の予定

*富山県金融経済懇話会において 日銀安達審議委員講演	*9月の米住宅着工件数 *米ベージュブック *9月のユーロ圏消費者物価指数改定値 *9月の英消費者物価指数	*国庫短期証券(1115回)入札 (1年、35,000億円、10/20発行)
-------------------------------	----------------------------------------------------------------	-------------------------------------------

◆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