

Central Daily Market Report

2022年10月19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19日 需給速報		2022年10月20日 需給予想		2022年10月21日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 1,200		▲ 1,000	
財政	▲ 9,800		▲ 3,200		2,000	
資金過不足	▲ 10,300		▲ 4,400		1,000	
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	1,000					
国債買入	100		800			
CP等買入		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入				▲ 300		
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	▲ 11,900	11,700		11,900		
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	▲ 9,600		7,600		1,000	
当座預金残高	4,901,900		4,909,500		4,910,500	
準備預金残高	4,273,900					
積み終了先	4,262,500		10月20日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,259,200		積数		31,500	
非準備預金先	628,000		1日平均		1,200	
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		99.19%		日数	
					12.90%	

●2022年10月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、ビッドがしっかりと入る中、レート水準は徐々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▲0.065~▲0.055%近辺で出会いが見られた。一巡後も、同水準で散発的な出会いが見られた程度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>

19日はTB1Y物(第1115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。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは概ね幅広い圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/19	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	▲ 0.056				-	▲ 0.084	0.250	0.000	27,257.38	101.24	149.20-21	149.33-36
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.060				-	▲ 0.089						
2W	▲ 0.058	▲ 0.003	▲ 0.047				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.110						
1M	▲ 0.060	▲ 0.010	▲ 0.033				-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.165	▲ 0.149						
6M							▲ 0.161	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.139						
									日付	10/12	10/13	10/14	10/17	10/18
									日銀当預残	4,858,800	4,854,500	4,930,900	4,895,400	4,911,500
									準備預金残	4,273,400	4,238,500	4,299,600	4,262,200	4,273,600
									マネタリーベース	6,108,100	6,104,400	6,181,100	6,145,300	6,161,400
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.033%	▲0.042%	▲0.065%	▲0.063%
									コール市場残高	176,331	180,238	155,075	151,981	147,964
									うち無担	143,109	149,608	122,346	118,977	115,094
									うちO/N	77,906	85,415	63,463	60,761	55,648
									うち有担	33,222	30,630	32,729	33,004	32,870

●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	素分率	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	1115	-	35,000	2022/10/20	2023/10/20	77,021.0	29,482.6	100.1020	▲0.1018%	29.3793%	100.1100	▲0.1098%	5,517.0

●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)		2022/10/19	2022/10/20	▲ 0.350	11,853	11,853		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/19	2022/10/20	▲ 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		2022/10/20		0.000	850	850				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/20		0.025	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20日の予定

*9月の貿易統計	*9月の米中古住宅販売
----------	-------------

◆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