

Central Daily Market Report

2022年10月20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20日 需給速報		2022年10月21日 需給予想		2022年10月24日 当社予想	
銀行券	▲ 1,300		▲ 600		▲ 500	
財政	▲ 3,600		5,800		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 4,900		5,200		▲ 1,500	
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						
国債買入	800		7,200			
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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		▲ 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	▲ 13,700	11,900		13,700		
※ドル資金供給用担保債提供額						
当預増減	▲ 6,600		25,700		▲ 1,500	
当座預金残高	4,895,300		4,921,000		4,919,500	
準備預金残高	4,270,300					
積み終了先	4,265,500		10月21日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,263,600		積数		24,800	
非準備預金先	625,000		1日平均		1,000	
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		99.36%		日数	
					16.13%	

●2022年10月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き積極的な資金調達が見られた事で、レート水準は前日に比べ上昇する展開となった。立ち上がりは、邦銀業態を中心に▲0.06~▲0.05%近辺で出会いが見られた。一巡後は、出し手の調整による散発的な出会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、▲0.07~▲0.085%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>

20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、複数の業態から発行が実施され、一部の業態で大型発行も見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/20	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	▲ 0.052				-	▲ 0.085	0.250	0.000	27,006.96	▲ 250.42	149.81-82	149.86-88
T/N							-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.063	▲ 0.060	▲ 0.061				-	▲ 0.087						
2W	▲ 0.062	0.180	▲ 0.030				-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.106						
1M			0.000				-	▲ 0.113						
3M							▲ 0.165	▲ 0.149						
6M							▲ 0.149	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.135						
									日付	10/13	10/14	10/17	10/18	10/19
									日銀当預残	4,854,500	4,930,900	4,895,400	4,911,500	4,901,900
									準備預金残	4,238,500	4,299,600	4,262,200	4,273,600	4,274,000
									マネタリーベース	6,104,400	6,181,100	6,145,300	6,161,400	6,152,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.033%	▲ 0.042%	▲ 0.065%	▲ 0.063%	▲ 0.056%
									コール市場残高	180,238	155,075	151,981	147,964	157,550
									うち無担	149,608	122,346	118,977	115,094	124,544
									うちO/N	85,415	63,463	60,761	55,648	62,148
									うち有担	30,630	32,729	33,004	32,870	33,006

●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)	簿札総額(億円・百万ドル)	簿分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均簿札レート・利回較差・価格較差	簿分比率
国債買入(残存期間5年超10年以下)	1,000	2022/10/21			4,008	1,003	0.003		0.004	69.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2022/10/21			2,238	1,002	0.037		0.039	59.5
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/10/21			2,022	501	0.024		0.026	35.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/20	2022/10/21	▲ 0.350	13,691	13,691		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/20	2022/10/21	▲ 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		2022/10/21		0.000	4,823	4,823				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/21		0.015	0	0				
社債等買入	1,000	2022/10/25			1,779	1,000	0.133		0.146	100.0

*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21日の予定

*9月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想：前年同月比(除く生鮮)+3.0%)	*国庫短期証券(1116回)入札 (3ヶ月、60,000億円、10/24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いますが、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	