

Central Daily Market Report

2022年10月21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21日 需給速報	2022年10月24日 需給予想	2022年10月25日 当社予想			
銀行券	▲ 700	▲ 200	▲ 500			
財政	5,000	▲ 5,000	43,000			
資金過不足	4,300	▲ 5,200	42,500			
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	7,200	22,500				
CP等買入		▲ 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		▲ 100	▲ 400	1,000		
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	▲ 9,700	13,700	9,700			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	15,100	26,600	43,500			
当座預金残高	4,910,400	4,937,000	4,980,500			
準備預金残高	4,299,400					
積み終了先	4,296,600			10月24日以降の残リ所要積立額		
超過準備	4,295,300			積数	12,200	
非準備預金先	611,000			1日平均	500	
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	99.69%	日数	25.81%		

●2022年10月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、緩やかな上昇基調が続くなか週末3日積みとなった事で、レート水準は前日に比べ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▲0.055~▲0.045%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、▲0.07~▲0.06%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>

21日はTB3M物(第1116回)の入札が実施され、事前予想に比べやや強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

<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。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/21	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	▲ 0.049				-	▲ 0.075	0.250	0.000	26,890.58	▲ 116.38	150.15-18	150.47-49
T/N							-	▲ 0.072						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.058	0.008	▲ 0.044				-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.058	▲ 0.045	▲ 0.054				-	▲ 0.091						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.175	▲ 0.143						
6M							▲ 0.149	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.133						
									日付	10/14	10/17	10/18	10/19	10/20
									日銀当預残	4,930,900	4,895,400	4,911,500	4,901,900	4,895,300
									準備預金残	4,299,600	4,262,200	4,273,600	4,274,000	4,269,800
									マネタリーベース	6,181,100	6,145,300	6,161,400	6,152,300	6,147,000
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.065%	▲0.063%	▲0.056%	▲0.052%
									コール市場残高	155,075	151,981	147,964	157,550	159,319
									うち無担	122,346	118,977	115,094	124,544	126,691
									うちO/N	63,463	60,761	55,648	62,148	63,045
									うち有担	32,729	33,004	32,870	33,006	32,628

●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)
国庫短期証券	1116	-	60,000	2022/10/24	2023/1/30	147,680.0	48,645.30	100.0365	▲0.1358%	33.2481%	100.0401	▲0.1492%	11,354.0

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2022/10/24			15,489	5,001	0.002		0.006	8.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,750	2022/10/24			10,856	5,756	▲0.003		▲0.003	73.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,500	2022/10/24			19,507	6,512	▲0.002		▲0.001	76.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2022/10/24			1,578	1,001	0.027		0.032	11.5
国債買入(物価連動債)	600	2022/10/24			3,554	602	▲0.600		▲0.608	71.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/21	2022/10/24	▲ 0.350	9,683	9,683		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/21	2022/10/24	▲ 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		2022/10/24			0.000	3,717	3,717			
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/24			0.010	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24日の予定

*特にありません

◆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