

# Central Daily Market Report

2022年10月24日(月)

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24日 需給速報	2022年10月25日 需給予想	2022年10月26日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 600	▲ 1,000			
財政	▲ 5,300	▲ 11,800	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 5,600	▲ 12,400	▲ 6,000			
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						▲ 8,200
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	22,500	1,000				
CP等買入			▲ 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		▲ 400	1,000	▲ 400		
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	▲ 17,000	9,700	17,000			
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	9,200	5,700	▲ 14,200			
当座預金残高	4,919,600	4,925,300	4,911,100			
準備預金残高	4,298,000					
積み終了先	4,295,600			10月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,295,400			積数	9,600	
非準備預金先	621,600			1日平均	400	
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	99.75%	日数	29.03%		

## ●2022年10月24日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.075~▲0.05%の調達で始まった。週末要因が剥落し、先週末対比でビッド水準を引き下げる動きが見られた。  
ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.075~▲0.07%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>

24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発行市場は案件少なく、閑散としたマーケットとなった。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

2022/10/24	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考値	平均値	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	▲ 0.057					-	▲ 0.074	0.250	0.000	26,974.90	84.32	147.70-16	149.25-27
T/N								-	▲ 0.075						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.063	▲ 0.060	▲ 0.061					-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.060	▲ 0.023	▲ 0.049					-	▲ 0.095						
3W								-	▲ 0.104						
1M								-	▲ 0.108						
3M								▲ 0.175	▲ 0.143						
6M								▲ 0.149	▲ 0.141						
1Y								▲ 0.119	▲ 0.132						
										日付	10/17	10/18	10/19	10/20	10/21
										日銀当預残	4,895,400	4,911,500	4,901,900	4,895,300	4,910,400
										準備預金残	4,262,200	4,273,600	4,274,000	4,269,800	4,297,800
										マネタリーベース	6,145,300	6,161,400	6,152,300	6,147,000	6,162,800
										無担O/N加重平均	▲0.065%	▲0.063%	▲0.056%	▲0.052%	▲0.049%
										コール市場残高	151,981	147,964	157,550	159,319	157,348
										うち無担	118,977	115,094	124,544	126,691	124,060
										うちO/N	60,761	55,648	62,148	63,045	58,644
										うち有担	33,004	32,870	33,006	32,628	33,288

## ●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)	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	平均着札レート・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)		2022/10/24	2022/10/25	▲ 0.350	17,016	17,016		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/24	2022/10/25	▲ 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		2022/10/25		0.000	1,046	1,046				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/25		0.005	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25日の予定

*月例経済報告	*8月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 *10月の米CB消費者信頼感指数	*流動性供給入札(5,000億円、10/26発行) *交付税特別会計借入(13,000億円、11/2借入)
---------	---	--

◆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