

Central Daily Market Report

2022年10月25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25日 需給速報	2022年10月26日 需給予想	2022年10月27日 当社予想
銀行券	▲ 700	▲ 500	▲ 1,000
財政	▲ 10,400	▲ 11,900	15,000
資金過不足	▲ 11,100	▲ 12,400	14,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		10,300	▲ 8,200
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		1,000	
国債買入	1,000	7,800	
CP等買入		▲ 500	▲ 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	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			▲ 2,400
国債補完供給	▲ 16,900	17,000	16,900
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	▲ 9,900	15,100	11,600
当座預金残高	4,909,700	4,924,800	4,936,400
準備預金残高	4,276,600		
積み終了先	4,275,400		
超過準備	4,275,000		
非準備預金先	633,100		
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	99.79%	日数
			32.26%

●2022年10月25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▲0.07~▲0.055%の調達で始まった。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での引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.075%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>

25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、やや弱めの結果となった。マーケットで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、大型案件を含め複数の業態で発行が見られた。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

2022/10/25	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	▲ 0.059				-	▲ 0.076	0.250	0.000	27,250.28	275.38	148.88-90	148.92-94
T/N							-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.060				-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.062	▲ 0.058	▲ 0.060				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.104						
1M							-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.175	▲ 0.142						
6M							▲ 0.149	▲ 0.141						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.134						
									日付	10/18	10/19	10/20	10/21	10/24
									日銀当預残	4,911,500	4,901,900	4,895,300	4,910,400	4,919,600
									準備預金残	4,273,600	4,274,000	4,269,800	4,297,800	4,298,000
									マネタリーベース	6,161,400	6,152,300	6,147,000	6,162,800	6,172,300
									無担O/N加重平均	▲0.063%	▲0.056%	▲0.052%	▲0.049%	▲0.057%
									コール市場残高	147,964	157,550	159,319	157,348	156,541
									うち無担	115,094	124,544	126,691	124,060	123,357
									うちO/N	55,648	62,148	63,045	58,644	57,191
									うち有担	32,870	33,006	32,628	33,288	33,184

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
流動性供給	368	-	5,000	2022/10/26	-	14,448.0	4,988.0	-	0.0670%	19.8770%	-	0.0600%	-	-
交付税特会	-	-	13,000	2022/11/2	2023/5/2	416,165.0	12,990.00	-	0.0000%	3.1214%	-	0.0000%	-	10.00

●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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>		2022/10/26	2022/11/9		10,300	10,300				
国庫短期証券買入	1,000	2022/10/26			6,173	1,001	0.011		0.019	9.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/25	2022/10/26	▲ 0.350	16,905	16,905		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/25	2022/10/26	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/10/27	2022/11/4	3.330	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		2022/10/26		0.000	7,863	7,863				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/26		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26日の予定

*9月の企業向けサービス価格指数	*9月の米新築一戸建て販売件数
*8月の景気動向指数改訂状況	

◆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