

Central Daily Market Report

2022年10月26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26日 需給速報	2022年10月27日 需給予想	2022年10月28日 当社予想	
銀行券	▲ 600	▲ 1,100	▲ 500	
財政	▲ 14,700	15,300	1,700	
資金過不足	▲ 15,300	14,200	1,200	
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	7,800	22,900		
CP等買入		▲ 300	▲ 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				
新型コロナ対応金融支援特別		2,100	▲ 2,400	
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 19,300	16,900	19,300	
※ドル資金供給用担保債供給				
当増減	▲ 7,100	55,700	1,200	
当座預金残高	4,902,600	4,958,300	4,959,500	
準備預金残高	4,260,400			
積み終了先	4,259,100	10月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,259,100	積数	6,700	
非準備預金先	642,200	1日平均	300	
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	99.83%	日数	35.48%

●2022年10月26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~▲0.06%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の引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲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>

26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、大型案件を含め多く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。また、CP等買入オペが、4,000億円でおファーされ、按分レート0.001%、平均レート0.012%と、前回(按分0.001%、平均0.006%)比で、按分は横ばい、平均では上昇となった。

●入札結果

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。

●2022年10月27日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(1日目、28日まで)

*ECB定例理事会(金融政策発表)

*7-9月期の米GDP速報値 *9月の米耐久財新規受注

*国庫短期証券(1117回)入札(3ヶ月、60,000億円、10/31発行)

*2年利付国債入札(28,000億円、11/1発行)

●短期金融市場関連指標

2022/10/26	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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.060				-	▲ 0.086	0.250	0.000	27,431.84	181.56	147.96-97	147.08-11
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.091						
2W			▲ 0.048				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.106						
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.111						
3M			0.011				▲ 0.158	▲ 0.139						
6M							▲ 0.149	▲ 0.141						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.133						
									日付	10/19	10/20	10/21	10/24	10/25
									日銀当預残	4,901,900	4,895,300	4,910,400	4,919,600	4,909,700
									準備預金残	4,274,000	4,269,800	4,297,800	4,298,000	4,275,600
									マネタリーベース	6,152,300	6,147,000	6,162,800	6,172,300	6,163,000
									無担O/N加重平均	▲0.056%	▲0.052%	▲0.049%	▲0.057%	▲0.059%
									コール市場残高	157,550	159,319	157,348	156,541	156,432
									うち無担	124,544	126,691	124,060	123,357	124,536
									うちO/N	62,148	63,045	58,644	57,191	59,570
									うち有担	33,006	32,628	33,288	33,184	31,896

●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3年超5年以下)	5,750	2022/10/27			7,850	5,755	▲0.034		▲0.030	7.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,500	2022/10/27			16,971	6,505	▲0.005		▲0.004	55.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,500	2022/10/27			8,928	3,507	▲0.050		▲0.046	10.0
国債買入(残存期間25年超)	1,500	2022/10/27			3,421	1,503	▲0.110		▲0.103	53.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/26	2022/10/27	▲ 0.350	19,310	19,310		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/26	2022/10/27	▲ 0.350	0	0				
CP等買入	4,000	2022/10/31			9,110	3,975	0.001		0.012	42.4
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/10/27		0.000	4,912	4,912				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/27		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。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
新型コロナ対応金融支援特別 制度融資分	2022/10/27	2023/1/27	0	1,248
新型コロナ対応金融支援特別 プロパー融資分	2022/10/27	2023/1/27	0	847

(参考) 2022/10/27時点の貸出残高 (億円)	
制度融資分(2022/4/1以降実行)	47,556
プロパー融資分(2022/4/1以降実行)	60,152
合計	107,708

◆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