

Central Daily Market Report

2022年10月27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27日 需給速報	2022年10月28日 需給予想	2022年10月31日 当社予想			
銀行券	▲ 1,200	▲ 600	1,500			
財政	15,200	5,800	▲ 3,000			
資金過不足	14,000	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	22,900	5,700				
CP等買入		▲ 400	▲ 900	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			▲ 200			
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ	2,100	▲ 2,400				
E T F買入						
国債補充供給	▲ 18,300	19,300	18,300			
当預増減	37,200	28,100	2,500			
当座預金残高	4,939,800	4,967,900	4,970,400			
準備預金残高	4,288,500					
積み終了先	4,287,300			10月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,287,300			積数	5,500	
非準備預金先	651,300			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	99.86%	日数	38.71%		

●2022年10月27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。レート水準は前日に比べやや上昇して推移する中、一巡後は同水準で散発的な出合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、▲0.09~▲0.08%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>

27日はTB3M物(第1117回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、月末発行に当たり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。

●短期金融市場関連指標

2022/10/27	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	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	▲ 0.056				-	▲ 0.085	0.250	0.000	27,345.24	▲ 86.60	146.07-10	145.71-74
T/N							-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.062	▲ 0.060	▲ 0.061				-	▲ 0.092						
2W			▲ 0.060				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.106						
1M							-	▲ 0.112						
3M			0.001				▲ 0.137	▲ 0.139						
6M							▲ 0.149	▲ 0.140						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.131						
日付		10/20	10/21	10/24	10/25	10/26								
日銀当預残	4,895,300	4,910,400	4,919,600	4,909,700	4,902,600									
準備預金残	4,269,800	4,297,800	4,298,000	4,275,600	4,258,200									
マネタリーベース	6,147,000	6,162,800	6,172,300	6,163,000	6,156,600									
無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.049%	▲0.057%	▲0.059%	▲0.060%									
コール市場残高	159,319	157,348	156,541	156,432	157,832									
うち無担	126,691	124,060	123,357	124,536	125,367									
うちO/N	63,045	58,644	57,191	59,570	59,951									
うち有担	32,628	33,288	33,184	31,896	32,465									

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1117	-	60,000	2022/10/31	2023/2/6	125,320.0	48,642.5	100.0340	▲0.1265%	53.2362%	100.0371	▲0.1381%	11,357.0
2年利付国債	442	0.005%	28,000	2022/11/1	2024/11/1	94,344.0	22,704.0	100.0650	▲0.0270%	41.4205%	100.0740	▲0.0310%	5,290.0

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/27	2022/10/28	▲ 0.350	18,153	18,153		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/27	2022/10/28	▲ 0.350	190	190		▲0.350	▲0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/10/28		0.000	5,764	5,764				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/28		0.025	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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28日の予定

- *日銀政策委員会・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *日銀総裁定例会見 *経済・物価情勢の展望
- *9月の完全失業率(市場予想:2.5%) *9月の有効求人倍率(市場予想:1.33倍)
- *10月の都区部消費者物価指数(GPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.1%)
- *9月の米個人所得・消費支出

◆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