

Central Daily Market Report

2022年10月28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28日 需給速報	2022年10月31日 需給予想	2022年11月1日 当社予想
銀行券	▲ 600	200	▲ 1,000
財政	7,700	▲ 300	▲ 26,000
資金過不足	7,100	▲ 100	▲ 27,000

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,700					
CP等買入		▲ 900	4,000	▲ 2,200		
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		▲ 200		
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 23,900	18,300		23,900		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増増減	6,100		25,400		▲ 27,000	

当座預金残高	4,945,900	4,971,300	4,944,300
準備預金残高	4,288,900		
積み終了先	4,288,000	10月31日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,287,800	積数	2,400
非準備預金先	657,000	1日平均	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 99.94%	日数 48.39%

●短期金融市場関連指標

2022/10/28	無担(速報)			有担(速報)			短期 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値
	最低	最高	平均	最低	最高	平均		
単位:%								
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.084
T/N							-	▲ 0.091
S/N							-	-
1W	▲ 0.062	0.008	▲ 0.059				-	▲ 0.092
2W	▲ 0.063	▲ 0.058	▲ 0.059				-	▲ 0.101
3W			▲ 0.060				-	▲ 0.106
1M	▲ 0.060	0.100	▲ 0.007				-	▲ 0.111
3M							▲ 0.137	▲ 0.136
6M							▲ 0.149	▲ 0.141
1Y							▲ 0.119	▲ 0.130

JGB新発10年債	日経平均株価		ドル/円		
	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
0.241	▲ 0.009	27,105.20	▲ 240.04	146.27-29	147.07-08
日付	10/21	10/24	10/25	10/26	10/27
日銀当預残	4,910,400	4,919,600	4,909,700	4,902,600	4,939,800
準備預金残	4,297,800	4,298,000	4,275,600	4,258,200	4,288,700
マネタリーベース	6,162,800	6,172,300	6,163,000	6,156,600	6,194,900
無担O/N加重平均	▲ 0.049%	▲ 0.057%	▲ 0.059%	▲ 0.060%	▲ 0.056%
コール市場残高	157,348	156,541	156,432	157,832	161,060
うち無担	124,060	123,357	124,536	125,367	129,209
うちO/N	58,644	57,191	59,570	59,951	63,373
うち有担	33,288	33,184	31,896	32,465	31,851

●オペ結果

種類	オフター額 (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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2022/10/28	2022/10/31	▲ 0.350	23,829	23,829		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2022/10/28	2022/10/31	▲ 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		2022/10/31		0.000	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/31		0.055	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2022/10/31		0.000	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※4		2022/10/31		0.055	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ター。
※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ター。
※3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ター。
※4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ター。

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について
1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。
(1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(全員一致)
① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。
短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
② 連続指値オペの運用
上記の金融市場調節方針を実現するため、10年物国債金利について0.25%の利回りで指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。
(2) 資産買入れ方針(全員一致)
長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
① ETFおよびJ-R E I Tについて、それぞれ年間約1兆2兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
② CP等、社債等については、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(CP等：約2兆円、社債等：約3兆円)へと徐々に戻していく。

●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

●2022年10月28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▲0.065~▲0.05%の調達で始まった。週末要因によりやや上昇する展開となり、一巡後も同水準での出会いが継続し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>

28日のアウトライ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、一部で大型発行が見られたものの案件は少なく、落ち着い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。

●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31日の予定

*9月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲1.0%)
*9月の商業動態統計速報 *10月の消費動向調査
*9月の住宅着工統計
*10月のシカゴPM景況感指数 *10月のユーロ圏消費者物価指数速報値
*7-9月期のユーロ圏GDP1次速報