

Central Daily Market Report

2022年10月31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31日 需給速報	2022年11月1日 需給予想	2022年11月2日 当社予想			
銀行券	100	▲ 300	1,000			
財政	5,300	▲ 35,500	▲ 30,500			
資金過不足	5,400	▲ 35,800	▲ 29,500			
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			1,000			
国債買入						
CP等買入	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				
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	▲ 23,700	23,900		23,700		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	7,200	▲ 11,100		▲ 29,500		
当座預金残高	4,953,100	4,942,000		4,912,500		
準備預金残高	4,305,300					
積み終了先	4,304,400				11月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,304,400				積数	1,500
非準備預金先	647,800				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	99.96%		日数		51.61%

●2022年10月31日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.07~▲0.06%程度の調達で始まった。月末の取引となり、調達を見送る先が一定数見られたため、レートは前営業日比で低下した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、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>

31日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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つ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。

●短期金融市場関連指標

2022/10/31	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	▲ 0.086	0.001	▲ 0.062				-	▲ 0.085	0.240	▲ 0.001	27,587.46	482.26	147.80-82	148.00-02
T/N							-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.063	▲ 0.060	▲ 0.062				-	▲ 0.092						
2W			▲ 0.060				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.106						
1M			▲ 0.060				-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.137	▲ 0.136						
6M							▲ 0.149	▲ 0.139						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.132						
									日付	10/24	10/25	10/26	10/27	10/28
									日銀当預残	4,919,600	4,909,700	4,902,600	4,939,800	4,945,900
									準備預金残	4,298,000	4,275,600	4,258,200	4,288,700	4,288,900
									マネタリーベース	6,172,300	6,163,000	6,156,600	6,194,900	6,201,600
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.059%	▲0.060%	▲0.056%	▲0.052%
									コール市場残高	156,541	156,432	157,832	161,060	169,891
									うち無担	123,357	124,536	125,367	129,209	136,688
									うちO/N	57,191	59,570	59,951	63,373	71,702
									うち有担	33,184	31,896	32,465	31,851	33,203

●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	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分比率
国庫短期証券買入	1,000	2022/11/1			6,938	1,001	0.012		0.014	64.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/31	2022/11/1	▲ 0.350	23,604	23,604		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/31	2022/11/1	▲ 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		2022/11/1		0.009	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		2022/11/1		0.060	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11月1日の予定

*米FOMC(1日目)	*10年利付国債入札 (27,000億円、11/2発行)
*9月の米建設支出	*交付税特別会計借入 (13,000億円、11/14借入)
*10月のISM 製造業景況指数	

◆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