Central Daily Market Report

2022年11月7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11月7日 需給速報		2022年11月8日 需給予想		2022年11月9日 当社予想	
銀行券	700		300		▲ 500	
財政	▲ 6,500		▲ 900		▲ 1,000	
資金過不足	▲ 5,800		▲ 600		▲ 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						▲ 10,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	700		100			
CP等買入		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 11,500	12,700		11,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 4,100		11,000		▲ 11,800	

当座預金残高	4,909,300	4,920,300	4,908,500
準備預金残高	4,303,700		
積み終了先	4,303,500		
超過準備	4,303,500		
非準備預金先	605,600		

11月8日以降の残り所要積立額	
積数	500
1日平均	100

積み期間（10/16～11/15）の所要準備額			3,871,400
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数 74.19%

●2022年11月7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▲0.065～▲0.055%程度の調達で始まった。週末要因剥落により、調達の目線を下げる先が散見されたことで、出合いのレート水準は前営業日比やや低下した。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、▲0.085～▲0.075%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>

7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発行市場は一部の業態で大型発行が実施された。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

2022/11/7	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.030	▲ 0.054				－	▲ 0.084
T/N							－	▲ 0.085
S/N							－	－
1W			▲ 0.060				－	▲ 0.089
2W	▲ 0.060	▲ 0.023	▲ 0.042				－	▲ 0.094
3W							－	▲ 0.101
1M			▲ 0.055				－	▲ 0.109
3M							▲ 0.115	▲ 0.131
6M							▲ 0.149	▲ 0.139
1Y							▲ 0.119	▲ 0.134

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）	為替（17時）
0.250	0.000	27,527.64	327.90	146.82-85	147.51-54

日付	10/28	10/31	11/1	11/2	11/4
日銀当預残	4,945,900	4,953,100	4,915,800	4,901,100	4,913,400
準備預金残	4,288,900	4,305,300	4,268,100	4,266,700	4,283,100
マネタリーベース	6,201,600	6,208,700	6,171,600	6,157,400	6,170,100
無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.062%	▲0.057%	▲0.055%	▲0.054%
コール市場残高	169,891	161,812	163,471	165,571	169,247
うち無担	136,688	132,452	132,572	134,727	138,052
うちO/N	71,702	72,655	71,485	72,790	74,865
うち有担	33,203	29,360	30,899	30,844	31,195

●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)
物価連動10年	27	0.005%	2,500	2022/11/8	2032/3/10	8,202.0	2,498.00	107.4000	▲0.7330%	78.1818%			

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/11/7	2022/11/8	▲ 0.350	11,517	11,517		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/11/7	2022/11/8	▲ 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		2022/11/8		0.000	61	61				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/11/8		0.025	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8日の予定

*決定会合における主な意見（10月27・28日分）
*10月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*9月の全世帯家計調査（市場予想：消費支出、前年比+2.7%）
*9月の毎月勤労統計調査速報
*9月の景気動向指数速報
*交付税特別会計借入
（13,000億円、11/18借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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