

Central Daily Market Report

2022年11月9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11月9日 需給速報	2022年11月10日 需給予想	2022年11月11日 当社予想
銀行券	700	▲ 500	500
財政	200	▲ 17,600	1,000
資金過不足	900	▲ 18,100	1,500
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	5,800	▲ 10,300	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	1,000		
国債買入	18,000		
CP等買入		▲ 100	▲ 100
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			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 12,900	12,500	12,900
※ドル資金供給用担保提供供給			
当預増減	14,900	▲ 5,300	1,500
当座預金残高	4,921,200	4,915,900	4,917,400
準備預金残高	4,294,200		
積み終了先	4,294,100		11月10日以降の残り所要積立額
超過準備	4,294,100		積数
非準備預金先	627,000		1日平均
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
			80.65%

●2022年11月9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。引き続き調達サイドが消極的ななか、ギブン地合いとなりレート水準は前日比でやや低下となった。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。ターム物は目立った出合いなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲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>

9日はTB6M物(第1119回)の入札が実施され、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発行市場は一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね幅広い圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/11/9	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.085	0.250	0.000	27,716.43	▲ 155.68	145.29-30	145.50-53
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.063				-	▲ 0.089						
2W							-	▲ 0.093						
3W							-	▲ 0.101						
1M							-	▲ 0.110						
3M			0.020				▲ 0.115	▲ 0.128						
6M							▲ 0.125	▲ 0.138						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.132						
									日付	11/1	11/2	11/4	11/7	11/8
									日銀当預残	4,915,800	4,901,100	4,913,400	4,909,300	4,906,300
									準備預金残	4,268,100	4,266,700	4,283,100	4,304,200	4,304,900
									マネタリーベース	6,171,600	6,157,400	6,170,100	6,165,300	6,161,900
									無担O/N加重平均	▲0.057%	▲0.055%	▲0.054%	▲0.054%	▲0.059%
									コール市場残高	163,471	165,571	169,247	173,246	167,443
									うち無担	132,572	134,727	138,052	141,874	138,043
									うちO/N	71,485	72,790	74,865	79,667	75,736
									うち有担	30,899	30,844	31,195	31,372	29,400

●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	1119	-	40,000	2022/11/10	2023/5/10	121,834.0	33,245.6	100.0500	▲0.1007%	48.3438%	100.0570	▲0.1148%	6,754.0
30年利付国債	76	1.400%	9,000	2022/11/10	2052/9/20	23,885.0	7,277.00	96.6000	1.5670%	60.1443%	96.7100	1.5610%	1,720.0

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/11/9	2022/11/10	▲ 0.350	12,870	12,870		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/9	2022/11/10	▲ 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		2022/11/10		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		2022/11/10		0.024	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10日の予定

*10月のマネーストック	*10月の米消費者物価指数	*エネルギー対策借入
*9月の特定サービス産業動態統計速報	*10月の米財政収支	(6,500億円、11/21借入)

◆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