

Central Daily Market Report

2022年11月10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11月10日 需給速報	2022年11月11日 需給予想	2022年11月14日 当社予想
銀行券	▲ 400	300	1,000
財政	▲ 18,700	800	▲ 10,000
資金過不足	▲ 19,100	1,100	▲ 9,000

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						
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
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	▲ 11,700	12,900		11,700		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	▲ 18,000		12,300		▲ 9,000	

当座預金残高	4,903,200	4,915,500	4,906,500	
準備預金残高	4,270,200			
積み終了先	4,270,100		11月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,270,100		積数	200
非準備預金先	633,000		1日平均	0

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	83.87%

●2022年11月10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~▲0.065%程度の調達で始まった。引き続き調達サイドにレート目線を引き下げる動きが散見されるなか、一巡後も朝方と同水準で散発的な出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は目立った出合いがなく閑散であった。

<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>

10日のアウトライト市場は動意なく閑散なか、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。また、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオフアされた。結果は按分落札レート0.001%、平均落札レート0.021%と、前回(按分0.001%、平均0.012%)比で、平均落札レートは上昇となった。

●短期金融市場関連指標

2022/11/10 単位: %	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.066				-	▲ 0.084	0.245	▲ 0.005	27,446.10	▲ 270.33	146.19-21	146.30-31
T/N	▲ 0.070	▲ 0.050	▲ 0.063				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.065				-	▲ 0.089						
2W							-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.101						
1M	▲ 0.001	0.150	0.020				-	▲ 0.110						
3M			0.000				▲ 0.125	▲ 0.126						
6M							▲ 0.125	▲ 0.135						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.132						

日付	11/2	11/4	11/7	11/8	11/9
日銀当預残	4,901,100	4,913,400	4,909,300	4,906,300	4,921,200
準備預金残	4,266,700	4,283,100	4,304,200	4,304,900	4,294,600
マネタリーベース	6,157,400	6,170,100	6,165,300	6,161,900	6,176,200
無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.054%	▲ 0.054%	▲ 0.059%	▲ 0.063%
コール市場残高	165,571	169,247	173,246	167,443	165,473
うち無担	134,727	138,052	141,874	138,043	134,744
うちO/N	72,790	74,865	79,667	75,736	71,437
うち有担	30,844	31,195	31,372	29,400	30,729

●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1非価格競争入札(億円)
エネルギー対策	-	-	6,500	2022/11/21	2023/11/20	144,945.0	6,499.99		0.0000%	4.4845%		0.0000%	

●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)		2022/11/10	2022/11/11	▲ 0.350	11,719	11,719		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/10	2022/11/11	▲ 0.350	0	0				
CP等買入	4,000	2022/11/15			7,158	3,965	0.001		0.021	78.2
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/11/11		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		2022/11/11		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11日の予定

*10月の企業物価指数	*New York祝日(Veterans Day) *11月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *7-9月期の英GDP速報値	*国庫短期証券(1120回)入札 (3ヶ月、60,000億円、11/14発行) *流動性供給入札 (5,000億円、11/14発行)
-------------	---------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------

◆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