

# Central Daily Market Report

2022年11月11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11月11日 需給速報	2022年11月14日 需給予想	2022年11月15日 当社予想
銀行券	200	700	▲ 1,000
財政	▲ 800	▲ 2,900	▲ 1,500
資金過不足	▲ 600	▲ 2,200	▲ 2,500
金融調節	スタート	エンド	スタート
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	▲ 500	▲ 200	4,000
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	▲ 12,400	11,700	12,400
※ドル資金供給用担保提供開始			
当預増減	▲ 1,800	10,000	1,500
当座預金残高	4,901,400	4,911,400	4,912,900
準備預金残高	4,269,700		
積み終了先	4,269,700		11月14日以降の残り所要積立額
超過準備	4,269,700		積数
非準備預金先	631,700		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	100.00%	日数
			93.55%

## ●2022年11月11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▲0.075~▲0.065%程度の調達で始まった。今積み期間最後の週末となったが、調達サイドに取り上げる動きは見られず、レート水準は前日比で横這いから僅かに低下となった。一巡後も大きな変化は無く、同水準で散発的な出会いが見られ、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~▲0.08%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>

11日はTB3M物(第1120回)の入札が実施され、小じっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでも堅調に推移した。

### <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、概ね横ばい圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/11/11	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	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	▲ 0.083	0.001	▲ 0.068				-	▲ 0.085	0.235	▲ 0.010	28,263.57	817.47	141.73-75	141.18-20
T/N							-	▲ 0.084						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	0.008	▲ 0.048				-	▲ 0.089						
2W	▲ 0.060	▲ 0.020	▲ 0.058				-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.101						
1M			0.045				-	▲ 0.109						
3M							▲ 0.136	▲ 0.125						
6M							▲ 0.125	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.131						
									日付	11/4	11/7	11/8	11/9	11/10
									日銀当預残	4,913,400	4,909,300	4,906,300	4,921,200	4,903,200
									準備預金残	4,283,100	4,304,200	4,304,900	4,294,600	4,270,400
									マネタリーベース	6,170,100	6,165,300	6,161,900	6,176,200	6,158,600
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.054%	▲0.059%	▲0.063%	▲0.066%
									コール市場残高	169,247	173,246	167,443	165,473	165,468
									うち無担	138,052	141,874	138,043	134,744	134,518
									うちO/N	74,865	79,667	75,736	71,437	72,411
									うち有担	31,195	31,372	29,400	30,729	30,950

## ●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	素分率	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)
国庫短期証券	1120	-	60,000	2022/11/14	2023/2/20	175,874.0	48,759.3	100.0285	▲0.1061%	29.3383%	100.0299	▲0.1113%	11,240.0
流動性供給	369	-	5,000	2022/11/14	-	19,634.0	4,996.0	-	▲0.0350%	33.9130%	-	▲0.0470%	-

## ●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)		2022/11/11	2022/11/14	▲ 0.350	12,335	12,335		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/11	2022/11/14	▲ 0.350	50	50		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/11/14		0.005	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		2022/11/14		0.077	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14日の予定

\*特にありません

◆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