Central Daily Market Report

2022年11月15日（火）
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15日 需給速報	2022年11月16日 需給予想	2022年11月17日 当社予想
銀行券	600	0	▲ 1,000
財政	4,900	▲ 29,100	1,000
資金過不足	5,500	▲ 29,100	0

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	12,000					
CP等買入	4,000	▲ 300		▲ 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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 12,400	12,400		12,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	21,200		▲ 15,800		0	

当座預金残高	4,922,500	4,906,700	4,906,700
準備預金残高	4,296,500		
積み終了先	4,296,500		
超過準備	4,296,500		
非準備預金先	626,000		

11月16日以降の残り所要積立額	
積数	3,767,900
1日平均	125,600

積み期間（11/16～12/15）の所要準備額	3,767,900

準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%

●2022年11月15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。積み最終日であったが、地合いに大きな変化は無く、前日比で概ね横這い圏での推移となった。ターム物は、ショートタームでの引き合いが見られた。

<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>

15日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、小甘い結果となった。なお、マーケットで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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/11/15	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	0.001	▲ 0.067				－	▲ 0.084
T/N							－	▲ 0.087
S/N							－	－
1W			▲ 0.070				－	▲ 0.093
2W	▲ 0.068	▲ 0.003	▲ 0.035				－	▲ 0.097
3W							－	▲ 0.104
1M	▲ 0.063	▲ 0.050	▲ 0.059				－	▲ 0.112
3M			0.005				▲ 0.136	▲ 0.126
6M							▲ 0.125	▲ 0.133
1Y							▲ 0.120	▲ 0.130

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）
0.240	0.000	27,990.17	26.70	140.07-09	139.33-35

日付	11/8	11/9	11/10	11/11	11/14
日銀当預残	4,906,300	4,921,200	4,903,200	4,901,400	4,901,300
準備預金残	4,304,900	4,294,600	4,270,400	4,269,800	4,288,700
マネタリーベース	6,161,900	6,176,200	6,158,600	6,156,600	6,155,800
無担O/N加重平均	▲0.059%	▲0.063%	▲0.066%	▲0.068%	▲0.067%
コール市場残高	167,443	165,473	165,468	169,491	167,997
うち無担	138,043	134,744	134,518	138,493	136,702
うちO/N	75,736	71,437	72,411	76,336	72,745
うち有担	29,400	30,729	30,950	30,998	31,295

●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)
5年利付国債	154	0.100%	25,000	2022/11/16	2027/9/20	67,129.0	20,308.0	100.1700	**0.0640%**	**80.1910%**	100.1900	**0.0600%**	4,685.0
国有林野借入	－	－	793	2022/11/25	2027/11/25	4,366.0	792.99	－	**0.0000%**	**33.3341%**	－	**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
国庫短期証券買入	1,000	2022/11/16			6,327	1,001	0.006		0.008	39.7
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/11/15	2022/11/16	▲ 0.350	12,333	12,333		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/11/15	2022/11/16	▲ 0.350	45	45		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2022/11/17	2022/11/25	4.080	2	2				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/11/16		0.010	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		2022/11/16		0.090	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16日の予定

*9月の機械受注統計
（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+0.7%）
*9月の第3次産業活動指数
*10月の米小売売上高
*10月の米鉱工業生産・設備稼働率
*9月の米企業在庫
*10月の英消費者物価指数

◆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