

# Central Daily Market Report

2022年11月16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16日 需給速報	2022年11月17日 需給予想	2022年11月18日 当社予想			
銀行券	0	▲ 800	▲ 500			
財政	▲ 30,000	2,500	▲ 9,000			
資金過不足	▲ 30,000	1,700	▲ 9,500			
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	100		▲ 100			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 100	▲ 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						▲ 200
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	▲ 11,000	12,400	11,000			
※ドル資金供給用担保提供開始						
当増減	▲ 27,600	12,400	▲ 9,700			
当座預金残高	4,894,900	4,907,300	4,897,600			
準備預金残高	4,245,400					
積み終了先	2,639,000			11月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,072,700			積数	595,200	
非準備預金先	649,500			1日平均	20,500	
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	84.20%	日数			3.33%

## ●2022年11月16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▲0.08~▲0.07%程度の調達で始まった。新積み期となり、マクロ加算残高にかかる基準比率が44%(前積み期49.5%)に低下した事で、ビッドサイドは調達余力の減少により、慎重な姿勢をとった先が多く、レート水準は低位での推移となった。ターム物は、ショートタームでの引き合いが見られた。本日は、3市場合同で実施する業務継続計画に関する訓練の一環として、固定金利方式による共通担保資金供給オペ(O/N物)が1,000億円オファーされ、54億円の落札となった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.080%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>

16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

2022/11/16	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		
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.070					-	▲ 0.085	0.240	0.000	28,028.30	38.13	138.95-97	139.37-39
T/N								-	▲ 0.087						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.068	▲ 0.020	▲ 0.051					-	▲ 0.094						
2W	▲ 0.070	0.180	▲ 0.049					-	▲ 0.099						
3W								-	▲ 0.106						
1M	▲ 0.068	▲ 0.030	▲ 0.046					-	▲ 0.112						
3M								▲ 0.136	▲ 0.126						
6M								▲ 0.125	▲ 0.133						
1Y								▲ 0.120	▲ 0.130						
日付		11/9	11/10	11/11	11/14	11/15									
日銀当預残		4,921,200	4,903,200	4,901,400	4,901,300	4,922,500									
準備預金残		4,294,600	4,270,400	4,269,800	4,288,700	4,297,400									
マネタリーベース		6,176,200	6,158,600	6,156,600	6,155,800	6,176,300									
無担O/N加重平均		▲0.063%	▲0.066%	▲0.068%	▲0.067%	▲0.067%									
コール市場残高		165,473	165,468	169,491	167,997	157,298									
うち無担		134,744	134,518	138,493	136,702	127,612									
うちO/N		71,437	72,411	76,336	72,745	63,505									
うち有担		30,729	30,950	30,998	31,295	29,686									

## ●入札結果

本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。

## ●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)		2022/11/16	2022/11/17	▲ 0.350	10,886	10,886		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/16	2022/11/17	▲ 0.350	0	0				
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞・即日	1,000	2022/11/16	2022/11/17		54	54				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/11/17		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		2022/11/17		0.105	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。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
被災地金融支援オペ	第18回 2022/11/18	2024/11/18	0	93

## ●2022年11月17日の予定

\*10月の貿易統計

\*9月の石油等消費動態統計

\*10月の米住宅着工件数

\*10月のユーロ圏消費者物価指数改定値

\*国庫短期証券(1121回)入札

(1年、35,000億円、11/21発行)

\*20年利付国債入札

(12,000億円、11/18発行)

\*交付税特別会計借入

(13,000億円、11/30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