

# Central Daily Market Report

2022年11月17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17日 需給速報		2022年11月18日 需給予想		2022年11月21日 当社予想	
銀行券	▲ 800		▲ 100		▲ 500	
財政	3,600		▲ 2,000		▲ 4,000	
資金過不足	2,800		▲ 2,100		▲ 4,500	
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				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 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			100	▲ 200		
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	▲ 10,700	11,000		10,700		
当預増減	2,800		8,000		▲ 4,500	
当座預金残高	4,897,700		4,905,700		4,901,200	
準備預金残高	4,255,800					
積み終了先	4,180,300		11月18日以降の残り所要積立額			
超過準備	3,757,800		積数		86,300	
非準備預金先	641,900		1日平均		3,100	
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	97.71%	日数	6.67%		

## ●2022年11月17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。マーケット参加者に大きな変化は無く、レート水準は前日比で概ね横ばい圏での推移となるなか、一巡後も同水準で散発的な出会いが見られた程度で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見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲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>

17日はTB1Y物(第1121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、小じっかりと推移した。

### <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

2022/11/17	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.071				-	▲ 0.084	0.240	0.000	27,930.57	▲ 97.73	139.31-34	139.32-33
T/N							-	▲ 0.089						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.093						
2W	▲ 0.070	▲ 0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.107						
1M	▲ 0.069	0.140	▲ 0.016				-	▲ 0.114						
3M							▲ 0.136	▲ 0.127						
6M							▲ 0.123	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.103	▲ 0.129						
									日付	11/10	11/11	11/14	11/15	11/16
									日銀当預残	4,903,200	4,901,400	4,901,300	4,922,500	4,894,900
									準備預金残	4,270,400	4,269,800	4,288,700	4,297,400	4,245,400
									マネタリーベース	6,158,600	6,156,600	6,155,800	6,176,300	6,148,800
									無担O/N加重平均	▲0.066%	▲0.068%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.070%
									コール市場残高	165,468	169,491	167,997	157,298	153,151
									うち無担	134,518	138,493	136,702	127,612	121,678
									うちO/N	72,411	76,336	72,745	63,505	61,086
									うち有担	30,950	30,998	31,295	29,686	31,473

## ●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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1121	-	35,000	2022/11/21	2023/11/20	108,898.0	28,764.7	100.0970	▲0.0971%	60.0187%	100.1000	▲0.1001%	6,235	
20年利付国債	182	1.100%	12,000	2022/11/18	2042/9/20	29,181.0	9,616.0	101.0000	1.0390%	22.0618%	101.1600	1.0290%	2,379	
交付税特会	-	-	13,000	2022/11/30	2023/5/31	426,578.0	12,990.27	-	0.0000%	3.0453%	-	0.0000%	-	10.00

## ●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)		2022/11/17	2022/11/18	▲ 0.350	10,428	10,428		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/17	2022/11/18	▲ 0.350	151	151		▲ 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		2022/11/18		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		2022/11/18		0.100	0	0				
社債等買入	1,000	2022/11/22			1,975	1,000	0.197		0.220	59.5

\*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18日の予定

*10月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想：前年同月比(除く生鮮)+3.5%)	*10月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1122回)入札 (3ヶ月、60,000億円、11/21発行)
--	--------------	--

◆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