Central Daily Market Report

2022年11月18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18日 需給速報		2022年11月21日 需給予想		2022年11月22日 当社予想	
銀行券	0		▲ 100		1,000	
財政	▲ 2,500		3,800		▲ 2,000	
資金過不足	▲ 2,500		3,700		▲ 1,000	
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		▲ 500		▲ 600		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援	100	▲ 200				
社債等買入					1,000	
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	▲ 12,200	10,700		12,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 4,600		15,300		0	

当座預金残高	4,893,100	4,908,400	4,908,400
準備預金残高	4,254,000		
積み終了先	4,249,700	11月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,235,600	積数	31,000
非準備預金先	639,100	1日平均	1,200
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 99.18%	日数	16.67%

●2022年11月18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▲0.085～▲0.065%程度の調達で始まった。積み期序盤であることやマーケット参加者に大きな変化が無いことから、レート水準は前日比で概ね横ばい圏での推移となった。一巡後も同水準で散発的な出合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%程度での出合い。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>

18日はTB3M物（第1122回）の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、やや買い進まれた。

<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

2022/11/18	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.071				－	▲ 0.085
T/N							－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W	▲ 0.073	0.008	▲ 0.067				－	▲ 0.094
2W	▲ 0.073	▲ 0.063	▲ 0.067				－	▲ 0.099
3W			▲ 0.069				－	▲ 0.107
1M	▲ 0.068	0.060	▲ 0.042				－	▲ 0.115
3M							▲ 0.120	▲ 0.126
6M							▲ 0.123	▲ 0.132
1Y							▲ 0.103	▲ 0.129

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）
0.245	0.005	27,899.77	▲ 30.80	140.42-44	139.81-84

日付	11/11	11/14	11/15	11/16	11/17
日銀当預残	4,901,400	4,901,300	4,922,500	4,894,900	4,897,700
準備預金残	4,269,800	4,288,700	4,297,400	4,245,400	4,257,100
マネタリーベース	6,156,600	6,155,800	6,176,300	6,148,800	6,152,400
無担O/N加重平均	▲0.068%	▲0.067%	▲0.067%	▲0.070%	▲0.071%
コール市場残高	169,491	167,997	157,298	153,151	160,434
うち無担	138,493	136,702	127,612	121,678	129,534
うちO/N	76,336	72,745	63,505	61,086	65,892
うち有担	30,998	31,295	29,686	31,473	30,900

●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)
国庫短期証券	1122	－	60,000	2022/11/21	2023/2/27	183,171.0	48,759.40	100.0300	**▲0.1117%**	**55.6309%**	100.0313	**▲0.1165%**	11,240.0

●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）		2022/11/18	2022/11/21	▲ 0.350	11,727	11,727		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/11/18	2022/11/21	▲ 0.350	149	149		▲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		2022/11/21		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		2022/11/21		0.115	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21日の予定

*特にありません

◆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