

Central Daily Market Report

2022年11月21日(月)

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21日 需給速報		2022年11月22日 需給予想		2022年11月24日 当社予想	
銀行券	▲ 100		▲ 500		1,400	
財政	3,200		▲ 2,100		▲ 5,000	
資金過不足	3,100		▲ 2,600		▲ 3,600	
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						▲ 5,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			18,000			
CP等買入		▲ 600		▲ 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			1,000			
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	▲ 9,200	12,200		9,200		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	5,500		25,500		▲ 9,400	
当座預金残高	4,898,600		4,924,100		4,914,700	
準備預金残高	4,242,200					
積み終了先	4,238,600		11月22日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,238,100		積数		26,800	
非準備預金先	656,400		1日平均		1,100	
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		99.29%		日数	
					20.00%	

●2022年11月21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。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.09%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>

21日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、1Y物に出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね幅広い圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/11/21	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.092	0.240	▲ 0.005	27,944.79	45.02	140.26-29	140.84-86
T/N							-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.063	▲ 0.070				-	▲ 0.098						
2W			▲ 0.030				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.110						
1M			0.000				-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.135	▲ 0.127						
6M							▲ 0.123	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.092	▲ 0.129						
									日付	11/14	11/15	11/16	11/17	11/18
									日銀当預残	4,901,300	4,922,500	4,894,900	4,897,700	4,893,100
									準備預金残	4,288,700	4,297,400	4,245,400	4,257,100	4,254,000
									マネタリーベース	6,155,800	6,176,300	6,148,800	6,152,400	6,147,800
									無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.067%	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%
									コール市場残高	167,997	157,298	153,151	160,434	164,543
									うち無担	136,702	127,612	121,678	129,534	133,932
									うちO/N	72,745	63,505	61,086	65,892	68,924
									うち有担	31,295	29,686	31,473	30,900	30,611

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/11/22			10,744	4,757	0.005		0.006	96.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/11/22			9,405	4,754	0.006		0.008	42.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/11/22			12,939	5,508	0.002		0.005	84.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2022/11/22			3,323	2,501	0.020		0.022	40.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/11/21	2022/11/22	▲ 0.350	9,106	9,106		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/21	2022/11/22	▲ 0.350	49	49		▲ 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		2022/11/22		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		2022/11/22		0.100	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22日の予定

*流動性供給入札 (5,000億円、11/24発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、12/2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