Central Daily Market Report

2022年11月24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24日 需給速報		2022年11月25日 需給予想		2022年11月28日 当社予想	
銀行券	▲ 1,000		▲ 500		▲ 500	
財政	▲ 5,100		38,200		▲ 11,000	
資金過不足	▲ 6,100		37,700		▲ 11,500	
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	1,500	▲ 5,800				
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		▲ 400		▲ 400		
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	▲ 11,400	10,200		11,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 11,000		48,700		▲ 11,500	

当座預金残高	4,904,700	4,953,400	4,941,900
準備預金残高	4,258,300		
積み終了先	4,255,600		
超過準備	4,255,300		
非準備預金先	646,400		

11月25日以降の残り所要積立額	
積数	17,200
1日平均	800

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	99.54%	日数 30.00%

●2022年11月24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～▲0.06%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合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、▲0.10～▲0.095%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>

24日の短国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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/11/24	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	▲ 0.073				－	▲ 0.093
T/N							－	▲ 0.101
S/N							－	－
1W			▲ 0.075				－	▲ 0.102
2W	▲ 0.060	0.000	▲ 0.020				－	▲ 0.106
3W							－	▲ 0.114
1M							－	▲ 0.120
3M							▲ 0.135	▲ 0.129
6M							▲ 0.123	▲ 0.129
1Y							▲ 0.094	▲ 0.128

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）
0.244	0.004	28,383.09	267.35	139.22-24	138.97-99

日付	11/16	11/17	11/18	11/21	11/22
日銀当預残	4,894,900	4,897,700	4,893,100	4,898,600	4,915,700
準備預金残	4,245,400	4,257,100	4,254,000	4,243,200	4,268,900
マネタリーベース	6,148,800	6,152,400	6,147,800	6,153,500	6,171,000
無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%	▲0.073%
コール市場残高	153,151	160,434	164,543	160,303	172,930
うち無担	121,678	129,534	133,932	129,962	141,342
うちO/N	61,086	65,892	68,924	63,205	73,435
うち有担	31,473	30,900	30,611	30,341	31,588

●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Ⅰ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/11/24	2022/11/25	▲ 0.350	11,389	11,389		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/11/24	2022/11/25	▲ 0.350	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/11/25		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		2022/11/25		0.095	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25日の予定

*11月の都区部消費者物価指数（CPI）
（市場予想：前年同月比（除く生鮮）+3.5%）
*10月の企業向けサービス価格指数
*国庫短期証券（1123回）入札
（3ヶ月、60,000億円、11/28発行）
*40年利付国債入札
（7,000億円、11/28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