

Central Daily Market Report

2022年11月28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28日 需給速報	2022年11月29日 需給予想	2022年11月30日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 500	▲ 1,000			
財政	▲ 9,100	▲ 5,100	9,000			
資金過不足	▲ 9,400	▲ 5,600	8,000			
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	100	13,600				
CP等買入		▲ 300	▲ 400	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 300	▲ 500			
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						▲ 3,000
E T F買入						
国債補完供給	▲ 9,200	8,800	9,200			
当預増減	▲ 10,300	16,300	9,000			
当座預金残高	4,933,100	4,949,400	4,958,400			
準備預金残高	4,268,300					
積み終了先	4,267,100			11月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,266,700			積数	7,900	
非準備預金先	664,800			1日平均	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	99.79%	日数	43.33%		

●2022年11月28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▲0.087~▲0.07%程度の調達で始まった。引き続き調達意欲は弱く、軟調な展開となる中、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、▲0.135~▲0.11%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>

28日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、多くの業態から大型発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●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。

●短期金融市場関連指標

2022/11/28	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	▲ 0.077					-	▲ 0.119	0.250	0.000	28,162.83	▲ 120.20	139.36-38	138.30-32
T/N								-	▲ 0.131						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.073	▲ 0.074					-	▲ 0.127						
2W	▲ 0.075	▲ 0.068	▲ 0.072					-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.128						
1M								-	▲ 0.132						
3M								▲ 0.200	▲ 0.139						
6M								▲ 0.123	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.110	▲ 0.130						
日付		11/18	11/21	11/22	11/24	11/25									
日銀当預残		4,893,100	4,898,600	4,915,700	4,904,700	4,943,400									
準備預金残		4,254,000	4,243,200	4,268,900	4,258,300	4,296,800									
マネタリーベース		6,147,800	6,153,500	6,171,000	6,161,000	6,200,100									
無担O/N加重平均		▲0.071%	▲0.072%	▲0.073%	▲0.073%	▲0.075%									
コール市場残高		164,543	160,303	172,930	163,898	169,682									
うち無担		133,932	129,962	141,342	132,235	137,926									
うちO/N		68,924	63,205	73,435	64,303	70,594									
うち有担		30,611	30,341	31,588	31,663	31,756									

●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)	投分レート ・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	投分 比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/11/29			8,700	4,755	0.000		0.000	86.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/11/29			12,604	5,507	▲0.004		0.000	9.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2022/11/29			5,537	2,513	0.009		0.011	36.8
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2022/11/29			2,553	1,006	0.013		0.014	38.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/11/28	2022/11/29	▲ 0.350	9,199	9,199		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/28	2022/11/29	▲ 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		2022/11/29		0.000	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		2022/11/29		0.060	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・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特別第38期(借り換え)	2022/12/2	2023/12/4	853	14
成長基盤強化	米ドル特別第34期(借り換え)	2022/12/2	2023/12/4	2,509	19
成長基盤強化	米ドル特別第30期(借り換え)	2022/12/2	2023/12/4	245	17

●2022年11月29日の予定

- *10月の完全失業率(市場予想:2.5%)
- *10月の有効求人倍率(市場予想:1.35倍)
- *10月の商業動態統計速報

*9月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

*2年利付国債入札
(28,000億円、12/1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