

Central Daily Market Report

2022年11月29日(火)

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29日 需給速報	2022年11月30日 需給予想	2022年12月1日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 700	▲ 1,500			
財政	▲ 5,600	2,000	▲ 31,000			
資金過不足	▲ 6,100	1,300	▲ 32,500			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	13,600		400			
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 2,500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 500				
新型コロナ対応金融支援特別 氣候変動対応オペ			2,800	▲ 3,000		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 9,200	9,200		9,200		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	6,600	13,200	▲ 32,500			
当座預金残高	4,939,700	4,952,900	4,920,400			
準備預金残高	4,271,000					
積み終了先	4,269,800			11月30日以降の残り所要積立額 積数	6,700	
超過準備	4,269,800			1日平均	400	
非準備預金先	668,700					
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	99.82%	日数	46.67%		

●2022年11月29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~▲0.075%程度の調達で始まった。前日に比べレート水準はやや低下し、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、▲0.135~▲0.11%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>

29日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、無難な結果となった。マーケットで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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。

●2022年11月30日の予定

- *10月の鉱工業生産・出荷・在庫速報 (市場予想:前月比▲1.5%)
- *10月の住宅着工統計
- *7-9月期の米GDP改定値
- *米ページブック
- *11月の米CB消費者信頼感指数
- *11月のシカゴPM景況感指数
- *11月のユーロ圏消費者物価指数速報値

●短期金融市場関連指標

2022/11/29	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	▲ 0.078				-	▲ 0.107	0.250	0.000	28,027.84	▲ 134.99	138.71-74	138.27-29
T/N								-	▲ 0.121						
S/N								-	-						
1W				▲ 0.075				-	▲ 0.122						
2W	▲ 0.078	▲ 0.003	▲ 0.064					-	▲ 0.124						
3W								-	▲ 0.128						
1M								-	▲ 0.135						
3M								▲ 0.200	▲ 0.139						
6M								▲ 0.130	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.110	▲ 0.128						
日付										11/21	11/22	11/24	11/25	11/28	
日銀当預残										4,898,600	4,915,700	4,904,700	4,943,400	4,933,100	
準備預金残										4,243,200	4,268,900	4,258,300	4,296,800	4,268,200	
マネタリーベース										6,153,500	6,171,000	6,161,000	6,200,100	6,190,000	
無担O/N加重平均										▲0.072%	▲0.073%	▲0.073%	▲0.075%	▲0.077%	
コール市場残高										160,303	172,930	163,898	169,682	163,313	
うち無担										129,962	141,342	132,235	137,926	132,910	
うちO/N										63,205	73,435	64,303	70,594	65,698	
うち有担										30,341	31,588	31,663	31,756	30,403	

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
2年利付国債	443	0.005%	28,000	2022/12/1	2024/12/1	92,726.0	23,019.00	100.0600	▲0.0240%	6.4613%	100.0700	▲0.0290%	4,975.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/11/30			6,277	1,000	0.006		0.006	90.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/11/29	2022/11/30	▲ 0.350	9,129	9,129		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/29	2022/11/30	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/12/1	2022/12/8	4.090	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		2022/11/30		0.000	439	439				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/11/30		0.065	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)	(参考)2022/11/30時点の貸出残高(億円)
新型コロナ対応金融支援特別	2022/11/30	2023/2/28	0	1,330	制度融資分 46,978
新型コロナ対応金融支援特別	2022/11/30	2023/2/28	0	1,458	プロパー融資分 60,535
					合計 107,513

◆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