

Central Daily Market Report

2022年10月6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10月6日 需給速報	2022年10月7日 需給予想	2022年10月11日 当社予想	
銀行券	▲ 800	▲ 100	1,000	
財政	▲ 100	▲ 4,800	▲ 8,000	
資金過不足	▲ 900	▲ 4,900	▲ 7,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
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	11,300	300		
CP等買入	▲ 100	▲ 200		
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援 社債等買入		▲ 200		
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				
E T F買入				
国債補完供給	▲ 17,100	16,100	17,100	
※ドル資金供給用担保提供特給				
当預増減	9,300	12,100	▲ 7,000	
当座預金残高	4,859,500	4,871,600	4,864,600	
準備預金残高	4,224,000			
積み終了先	4,224,000	10月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,223,100	積数	200	
非準備預金先	635,500	1日平均	0	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額			3,750,600	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	70.00%

●2022年10月6日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続きレート水準が上昇基調となっている。朝方は邦銀業態を中心に▲0.048~▲0.035%近辺での出合いが中心となり、一巡後も同水準での出合いが見られた。
ターム物については、ショートターム物を中心に目撃が出合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.11~▲0.08%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>

6日はTB6M物(第1112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も、底堅く推移した。

<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

2022/10/6	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	
	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)	為替(17時)
単位：%									0.245	0.000	27,311.30	190.77	144.42-44	144.57-60
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.098						
T/N	▲ 0.040	▲ 0.035	▲ 0.036				-	▲ 0.113						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	0.008	▲ 0.048				-	▲ 0.121						
2W	▲ 0.060	0.180	▲ 0.012				-	▲ 0.125						
3W	▲ 0.060	▲ 0.059	▲ 0.060				-	▲ 0.130						
1M	▲ 0.060	0.200	▲ 0.011				-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.275	▲ 0.164						
6M							▲ 0.161	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.144						
日付		9/29	9/30	10/3	10/4	10/5								
日銀当預残		4,924,400	4,930,300	4,920,700	4,879,800	4,850,200								
準備預金残		4,290,300	4,326,300	4,297,100	4,242,700	4,211,200								
マネタリーベース		6,175,500	6,180,600	6,170,500	6,129,300	6,099,900								
無担O/N加重平均		▲0.066%	▲0.073%	▲0.065%	▲0.059%	▲0.052%								
コール市場残高		176,460	133,196	170,551	164,802	183,193								
うち無担		143,967	102,783	140,224	132,827	150,944								
うちO/N		78,260	64,030	83,281	71,439	83,126								
うち有担		32,493	30,413	30,327	31,975	32,249								

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1112	-	40,000	2022/10/11	2023/4/10	128,759.0	32,428.9	100.0790	▲0.1591%	72.2400%	100.0850	▲0.1712%	7,571.0
流動性供給	367	-	5,000	2022/10/7	-	31,886.0	4,989.0	-	0.0030%	23.8297%	-	0.0010%	-
エネルギー対策	-	-	6,500	2022/10/20	2023/10/20	151,247.0	6,499.8	-	0.0000%	4.4906%	-	0.0000%	-

●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)		2022/10/6	2022/10/7	▲ 0.350	16,984	16,984		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/6	2022/10/7	▲ 0.350	7	7		▲ 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		2022/10/7		0.005	320	320				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/7		0.085	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10月7日の予定

*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*9月の米雇用統計	*国庫短期証券(1113回)
*8月の毎月勤労統計調査速報	*8月の米卸売売上高	(3ヶ月、60,000億円、10/11発行)
*8月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比+6.7%)	*8月の米消費者信用残高	
*8月の特定サービス産業動態統計速報		
*8月の景気動向指数速報		

◆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