

Central Daily Market Report

2022年10月17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10月17日 需給速報		2022年10月18日 需給予想		2022年10月19日 当社予想	
銀行券	300		0		▲ 1,000	
財政	▲ 41,100		1,900		▲ 12,000	
資金過不足	▲ 40,800		1,900		▲ 13,000	
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	1,200		12,400			
CP等買入	4,000	▲ 500		▲ 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				▲ 100		
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						
国債補充供給	▲ 13,400	14,000		13,400		
当預増減	▲ 35,500		27,400		▲ 13,000	
当座預金残高	4,895,400		4,922,800		4,909,800	
準備預金残高	4,262,200					
積み終了先	4,145,300		10月18日以降の残リ所要積立額		積数 96,900	
超過準備	3,741,800		1日平均		3,300	
非準備預金先						
積み期間(10/16~11/15)の所要準備額					3,874,800	
準備預金進捗率	実績 97.50%		日数 6.45%			

●2022年10月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、実質的な積み初日にあたることから、調達サイドは慎重な姿勢を取る先が多く、出会い水準は前営業日に比べ低下した。レート目線が定まりづらいなか、ターム物の出会い水準を手掛かりに▲0.07~▲0.06%近辺での出会いが中心となった。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、ショートタームを中心に▲0.065~▲0.055%近辺での出会いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.090~▲0.08%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>

17日のアウトライト市場は動意なく閑散なか、特段の出会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。発行レートは概ね幅広い圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/10/17	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.065				-	▲ 0.084	0.250	0.005	26,775.79	▲ 314.97	148.63-65	148.64-65
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.063	▲ 0.055	▲ 0.061				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.065	0.100	▲ 0.060				-	▲ 0.098						
3W							-	▲ 0.110						
1M	▲ 0.065	▲ 0.028	▲ 0.060				-	▲ 0.121						
3M			0.010				▲ 0.165	▲ 0.152						
6M							▲ 0.161	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.143						
									日付	10/7	10/11	10/12	10/13	10/14
									日銀当預残	4,854,600	4,840,300	4,858,800	4,854,500	4,930,900
									準備預金残	4,230,600	4,254,000	4,273,400	4,238,500	4,299,600
									マネタリーベース	6,105,300	6,090,400	6,108,100	6,104,400	6,181,100
									無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.022%	▲0.026%	▲0.033%	▲0.042%
									コール市場残高	191,890	170,705	176,331	180,238	155,075
									うち無担	159,973	139,552	143,109	149,608	122,346
									うちO/N	86,405	72,869	77,906	85,415	63,463
									うち有担	31,917	31,153	33,222	30,630	32,729

●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	2022/10/18			15,554	4,756	▲0.001		0.001	62.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/10/18			16,729	5,509	0.005		0.007	91.5
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2022/10/18			3,915	1,006	0.035		0.039	14.2
国債買入(変動利付債)	300	2022/10/18			300	300		▲1.450	▲1.452	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/10/17	2022/10/18	▲ 0.350	12,911	12,911		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/10/17	2022/10/18	▲ 0.350	436	436		▲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		2022/10/18		0.005	870	870				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/10/18		0.030	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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18日の予定

*9月の米鉱工業生産・設備稼働率	*20年利付国債入札(12,000億円、10/19発行)
<p>◆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。</p> <p>◆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。</p> <p>◆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。</p> <p>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</p>	