

Central Daily Market Report

2022年11月2日(水)
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2日 需給速報		2022年11月4日 需給予想		2022年11月7日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 400		1,000	
財政	▲ 24,900		600		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 25,400		200		▲ 2,000	
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			12,100			
CP等買入				▲ 300		
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						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 12,500	23,200		12,500		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 14,700		24,500		▲ 2,000	
当座預金残高	4,901,100		4,925,600		4,923,600	
準備預金残高	4,266,700					
積み終了先	4,266,600		11月4日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	4,266,500				900	
非準備預金先	634,400		1日平均		100	
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	99.98%	日数	61.29%		

●2022年11月2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▲0.065~▲0.05%程度の調達で始まった。幅広い業態からの調達が見られたことで、レート水準は前日比でやや上昇した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲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>

2日のアウトライイト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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●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

2022/11/2	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.055				-	▲ 0.084	0.245	▲ 0.005	27,663.39	▲ 15.53	147.89-91	147.33-35
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.058	0.180	▲ 0.040				-	▲ 0.097						
3W							-	▲ 0.102						
1M	▲ 0.070	0.200	0.003				-	▲ 0.108						
3M							▲ 0.137	▲ 0.135						
6M							▲ 0.149	▲ 0.140						
1Y							▲ 0.119	▲ 0.134						
									日付	10/26	10/27	10/28	10/31	11/1
									日銀当預残	4,902,600	4,939,800	4,945,900	4,953,100	4,915,800
									準備預金残	4,258,200	4,288,700	4,288,900	4,305,300	4,268,100
									マネタリーベース	6,156,600	6,194,900	6,201,600	6,208,700	6,171,600
									無担O/N加重平均	▲0.060%	▲0.056%	▲0.052%	▲0.062%	▲0.057%
									コール市場残高	157,832	161,060	169,891	161,812	163,471
									うち無担	125,367	129,209	136,688	132,452	132,572
									うちO/N	59,951	63,373	71,702	72,655	71,485
									うち有担	32,465	31,851	33,203	29,360	30,899

●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1年以下)	1,500	2022/11/4			2,238	1,503	▲0.010		0.002	9.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/11/4			14,624	4,754	▲0.003		▲0.001	21.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/11/4			8,327	4,752	▲0.002		0.001	3.3
国債買入(残存期間5年超)	1,000	2022/11/4			2,559	1,003	0.019		0.021	38.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/11/2	2022/11/4	▲ 0.350	12,513	12,513		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/2	2022/11/4	▲ 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		2022/11/4			0.000	30				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/11/4			0.060	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3日の予定

*文化の日

*英中銀MPC結果発表

*9月の米貿易収支

*9月の米製造業新規受注・出荷・在庫

*10月のISM 非製造業景況指数

●2022年11月4日の予定

*11月の日銀当座預金増減要因見込み

*10月の米雇用統計

*国庫短期証券(1118回)入札
(3ヶ月、60,000億円、11/7発行)

◆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