Central Daily Market Report

2022年11月8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8日 需給速報		2022年11月9日 需給予想		2022年11月10日 当社予想	
銀行券	300		700		1,000	
財政	▲ 2,400		▲ 1,400		▲ 17,500	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 700		▲ 16,500	
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			5,800	▲ 10,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	100		18,000			
CP等買入				▲ 100		
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 12,500	11,500		12,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 3,000		26,200		▲ 16,500	

当座預金残高	4,906,300	4,932,500	4,916,000
準備預金残高	4,304,300		
積み終了先	4,304,200	11月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,304,200	積数	400
非準備預金先	602,000	1日平均	100
積み期間（10/16～11/15）の所要準備額			3,871,400
準備預金進捗率	実績 99.99%	日数	77.42%

●2022年11月8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～▲0.06%程度の調達で始まった。運用サイドの資金量が潤沢なことを背景に、調達サイドは目線を引き下げる動きが見られ、レート水準は前日比で低下した。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。ターム物は目立った出合いなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085～▲0.080%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>

8日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●2022年11月8日の予定

*9月の国際収支 *10月の景気ウォッチャー調査
*9月の米卸売売上高
*国庫短期証券(1119回)入札（6ヶ月、40,000億円、11/10発行）
*30年利付国債入札（9,000億円、11/10発行）

●短期金融市場関連指標

2022/11/8	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.059				－	▲ 0.086
T/N							－	▲ 0.085
S/N							－	－
1W	▲ 0.063	▲ 0.015	▲ 0.039				－	▲ 0.089
2W							－	▲ 0.095
3W							－	▲ 0.101
1M			▲ 0.057				－	▲ 0.109
3M							▲ 0.115	▲ 0.130
6M							▲ 0.149	▲ 0.139
1Y							▲ 0.120	▲ 0.134

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.250	0.000	27,872.11	344.47	146.61-63	146.72-74

日付	10/31	11/1	11/2	11/4	11/7
日銀当預残	4,953,100	4,915,800	4,901,100	4,913,400	4,909,300
準備預金残	4,305,300	4,268,100	4,266,700	4,283,100	4,304,200
マネタリーベース	6,208,700	6,171,600	6,157,400	6,170,100	6,165,300
無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.057%	▲0.055%	▲0.054%	▲0.054%
コール市場残高	161,812	163,471	165,571	169,247	173,246
うち無担	132,452	132,572	134,727	138,052	141,874
うちO/N	72,655	71,485	72,790	74,865	79,667
うち有担	29,360	30,899	30,844	31,195	31,372

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
交付税特会	－	－	13,000	2022/11/18	2023/5/23	418,429.0	12,990.29	－	0.0000%	3.1046%	－	0.0000%	－	10.00

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞		2022/11/9	2022/11/24		5,801	5,801				
国庫短期証券買入	1,000	2022/11/9			5,906	1,001	0.012		0.015	54.1
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,750	2022/11/9			13,130	4,754	▲0.004		▲0.003	42.9
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,750	2022/11/9			7,686	4,755	▲0.006		▲0.004	75.6
国債買入（残存期間5年超10年以下）	5,500	2022/11/9			16,683	5,513	▲0.002		▲0.001	82.5
国債買入（残存期間10年超25年以下）	2,500	2022/11/9			7,635	2,510	0.018		0.020	8.4
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/11/8	2022/11/9	▲ 0.350	12,453	12,453		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/11/8	2022/11/9	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/11/10	2022/11/17	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		2022/11/9		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		2022/11/9		0.025	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。

◆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。
◆本資料は何ら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論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