

Central Daily Market Report

2022年11月14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11月14日 需給速報	2022年11月15日 需給予想	2022年11月16日 当社予想
銀行券	700	700	▲ 1,000
財政	▲ 600	3,000	▲ 28,000
資金過不足	100	3,700	▲ 29,000
金融調節	スタート	エンド	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		12,000	
CP等買入	▲ 200	4,000	▲ 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			
新型コロナウイルス感染症 気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 12,400	12,400	12,400
※ドル資金供給用担保提供増額			
当預増減	▲ 100	31,800	▲ 29,000
当座預金残高	4,901,300	4,933,100	4,904,100
準備預金残高	4,288,700		
積み終了先	4,288,700		11月15日以降の残り所要積立額
超過準備	4,288,700		積数
非準備預金先	612,600		1日平均
			0
			0
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	100.00%	日数
			96.77%

●2022年11月14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▲0.075~▲0.065%程度の調達で始まった。積み期間は終盤を迎えているが、特段取り上がる動きは見られず、前営業日比で概ね横這い圏での推移となった。一巡後は、徐々にビッドが減少し、レート水準が低下した事で、低位での出会いも散見された。ターム物は、ショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.080%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>

14日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会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。

●短期金融市場関連指標

2022/11/14	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	▲ 0.067				-	▲ 0.084	0.240	0.005	27,963.47	▲ 300.10	139.60-62	139.49-52
T/N			▲ 0.060				-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.067	0.008	▲ 0.063				-	▲ 0.091						
2W	▲ 0.065	▲ 0.052	▲ 0.061				-	▲ 0.096						
3W							-	▲ 0.102						
1M	▲ 0.070	▲ 0.065	▲ 0.068				-	▲ 0.110						
3M			0.025				▲ 0.136	▲ 0.127						
6M							▲ 0.125	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.120	▲ 0.131						
									日付	11/7	11/8	11/9	11/10	11/11
									日銀当預残	4,909,300	4,906,300	4,921,200	4,903,200	4,901,400
									準備預金残	4,304,200	4,304,900	4,294,600	4,270,400	4,269,800
									マネタリーベース	6,165,300	6,161,900	6,176,200	6,158,600	6,156,600
									無担O/N加重平均	▲0.054%	▲0.059%	▲0.063%	▲0.066%	▲0.068%
									コール市場残高	173,246	167,443	165,473	165,468	169,491
									うち無担	141,874	138,043	134,744	134,518	138,493
									うちO/N	79,667	75,736	71,437	72,411	76,336
									うち有担	31,372	29,400	30,729	30,950	30,998

●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。

●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	2022/11/15			16,850	4,754	0.002		0.003	48.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/11/15			14,332	5,513	0.006		0.009	71.5
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2022/11/15			2,301	1,004	0.032		0.034	28.3
国債買入(物価連動債)	600	2022/11/15			2,682	600	▲0.300		▲0.391	39.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/11/14	2022/11/15	▲ 0.350	12,339	12,339		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/11/14	2022/11/15	▲ 0.350	9	9		▲0.350	▲0.357	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/11/15		0.015	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		2022/11/15		0.110	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11月15日の予定

*7-9月期のGDP1次速報
(市場予想：前年比年率+1.1%)

*10月の米生産者物価指数
*7-9月期のユーロ圏GDP2次速報

*5年利付国債入札
(25,000億円、11/16発行)
*国有林野借入
(793億円、11/25借入)

◆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