Central Daily Market Report

2022年11月22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22日 需給速報		2022年11月24日 需給予想		2022年11月25日 当社予想	
銀行券	▲ 500		▲ 900		▲ 500	
財政	▲ 300		▲ 5,200		49,000	
資金過不足	▲ 800		▲ 6,100		48,500	
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			1,500	▲ 5,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	18,000					
CP等買入		▲ 100		▲ 400		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入	1,000					
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	▲ 10,200	9,200		10,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	17,100		400		48,500	

当座預金残高	4,915,700	4,916,100	4,964,600
準備預金残高	4,268,900		
積み終了先	4,265,800		
超過準備	4,265,600		
非準備預金先	646,800		

11月24日以降の残り所要積立額	
積数	20,200
1日平均	900

積み期間（11/16～12/15）の所要準備額			3,767,900
準備預金進捗率	実績	99.46%	日数 26.67%

●2022年11月22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▲0.085～▲0.065%程度の調達で始まった。祝日を含む2日積みの取引となったものの、取り手の姿勢に大きな変化は見られず、一巡後は出し手の調整による散発的な出合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で引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095%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>

22日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、無難な結果となった。なお、マーケットで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、五・十日発行にあたり、幅広い業態が発行を実施し、大型発行も見られた。発行レートに大きな変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/11/22	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.073				－	▲ 0.092
T/N							－	▲ 0.099
S/N							－	－
1W			▲ 0.070				－	▲ 0.101
2W			▲ 0.075				－	▲ 0.107
3W			▲ 0.060				－	▲ 0.114
1M							－	▲ 0.121
3M							▲ 0.135	▲ 0.128
6M							▲ 0.123	▲ 0.130
1Y							▲ 0.094	▲ 0.129

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）
0.240	0.000	28,115.74	170.95	142.08-10	141.80-82

日付	11/15	11/16	11/17	11/18	11/21
日銀当預残	4,922,500	4,894,900	4,897,700	4,893,100	4,898,600
準備預金残	4,297,400	4,245,400	4,257,100	4,254,000	4,243,200
マネタリーベース	6,176,300	6,148,800	6,152,400	6,147,800	6,153,500
無担O/N加重平均	▲0.067%	▲0.070%	▲0.071%	▲0.071%	▲0.072%
コール市場残高	157,298	153,151	160,434	164,543	160,303
うち無担	127,612	121,678	129,534	133,932	129,962
うちO/N	63,505	61,086	65,892	68,924	63,205
うち有担	29,686	31,473	30,900	30,611	30,341

●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)
流動性供給	370	－	5,000	2022/11/24	－	26,927.0	4,995.00	－	▲0.0030%	99.1150%	－	▲0.0050%	－	
交付税特会	－	－	13,000	2022/12/2	2023/6/2	428,151.0	12,990.04	－	0.0000%	3.0340%	－	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＞		2022/11/24	2022/12/7		1,502	1,502				
国庫短期証券買入	1,000	2022/11/24			7,428	1,002	0.006		0.007	52.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/11/22	2022/11/24	▲ 0.350	10,059	10,059		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/11/22	2022/11/24	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/11/25	2022/12/1	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		2022/11/24		0.010	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		2022/11/24		0.100	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23日の予定

*勤労感謝の日　*10月の米耐久財新規受注
*10月の米新築一戸建て販売件数

●2022年11月24日の予定

*月例経済報告　*New York祝日（Thanksgiving Day）
*9月の景気動向指数改訂状況

◆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