Central Daily Market Report

2022年11月30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30日 需給速報		2022年12月1日 需給予想		2022年12月2日 当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 1,100		▲ 1,500	
財政	▲ 1,400		▲ 53,900		▲ 87,000	
資金過不足	▲ 2,100		▲ 55,000		▲ 88,500	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入	400		1,400			
CP等買入	4,000	▲ 2,500		▲ 100		
貸出支援基金（成）						▲ 4,100
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	2,800	▲ 3,000				
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 8,400	9,200		8,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	1,400		▲ 45,300		▲ 92,600	

当座預金残高	4,941,100	4,895,800	4,803,200
準備預金残高	4,292,300		
積み終了先	4,291,000		
超過準備	4,291,000		
非準備預金先	648,800		

12月1日以降の残り所要積立額	
積数	5,500
1日平均	400

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	99.85%	日数 50.00%

●2022年11月30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▲0.087～▲0.078%程度の調達で始まった。月末につき調達を控えた先もあり、一巡後は徐々にビッドサイドが薄くなり、目立った出合いは見られなかった。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、▲0.135～▲0.105%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>

30日のアウトラ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、案件が少なく、閑散としたマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/11/30	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	▲ 0.079				－	▲ 0.115
T/N							－	▲ 0.128
S/N							－	－
1W			▲ 0.075				－	▲ 0.126
2W	▲ 0.078	▲ 0.035	▲ 0.058				－	▲ 0.127
3W							－	▲ 0.131
1M			▲ 0.075				－	▲ 0.148
3M							▲ 0.200	▲ 0.140
6M							▲ 0.130	▲ 0.131
1Y							▲ 0.110	▲ 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）
0.250	0.000	27,968.99	▲ 58.85	138.75-76	138.52-54

日付	11/22	11/24	11/25	11/28	11/29
日銀当預残	4,915,700	4,904,700	4,943,400	4,933,100	4,939,700
準備預金残	4,268,900	4,258,300	4,296,800	4,268,200	4,271,200
マネタリーベース	6,171,000	6,161,000	6,200,100	6,190,000	6,197,100
無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.073%	▲0.075%	▲0.077%	▲0.078%
コール市場残高	172,930	163,898	169,682	163,313	158,945
うち無担	141,342	132,235	137,926	132,910	129,595
うちO/N	73,435	64,303	70,594	65,698	62,393
うち有担	31,588	31,663	31,756	30,403	29,350

●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Ｉ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/11/30	2022/12/1	▲ 0.350	8,356	8,356		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/11/30	2022/12/1	▲ 0.350	51	51		▲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		2022/12/1		0.000	1,365	1,365				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/12/1		0.045	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※3		2022/12/1		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
※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。※3固定利回較差の結果、10年利付国債358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12月1日の予定

*秋田県金融経済懇談会において
野口日銀審議委員講演
*7-9月期の法人企業統計調査季報
*11月の消費動向調査
*10月の米個人所得・消費支出
*10月の米建設支出
*11月のISM 製造業景況指数
*10年利付国債入札
（27,000億円、12/2発行）
*交付税特別会計借入
（13,000億円、12/9借入）

◆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