

Central Daily Market Report

2022年9月22日(木)
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9月22日 需給速報	2022年9月26日 需給予想	2022年9月27日 当社予想			
銀行券	▲ 900	400	500			
財政	▲ 1,900	31,500	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 2,800	31,900	▲ 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						
国債買入	15,200	3,700				
CP等買入		▲ 600	▲ 500			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入	800	▲ 100				
新型コロナウイルス対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 12,600	6,300	12,600			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当増増減	6,200	47,700	▲ 500			
当座預金残高	5,141,800	5,189,500	5,189,000			
準備預金残高	4,511,400					
積み終了先	4,509,900			9月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,509,300			積数	13,400	
非準備預金先	630,400			1日平均	700	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額					3,750,600	
準備預金進捗率	実績	99.64%	日数	33.33%		

●2022年9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、三連休前の4日積みとなったものの、取り上がる先は少なく、引き続き邦銀業態を中心に▲0.06~▲0.05%の出合いが中心となった。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、期内物のショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.08%程度での出合い。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日の短国市場は動意なく閑散な中、3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施されたものの、案件少なく落ち着い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。

●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。

●2022年9月23日の予定

●2022年9月26日の予定

*秋分の日

*特にありません

●短期金融市場関連指標

2022/9/22	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.055					-	▲ 0.086	0.235	▲ 0.015	27,153.83	▲ 159.30	144.23-25	145.77-78
T/N								-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.065	0.001	▲ 0.034					-	▲ 0.126						
2W								-	▲ 0.132						
3W								-	▲ 0.130						
1M								-	▲ 0.129						
3M								▲ 0.238	▲ 0.131						
6M								▲ 0.235	▲ 0.149						
1Y								▲ 0.149	▲ 0.145						
										日付	9/14	9/15	9/16	9/20	9/21
										日銀当預残	5,048,800	5,060,100	5,048,000	5,133,400	5,135,600
										準備預金残	4,436,600	4,458,200	4,423,400	4,494,900	4,495,900
										マネタリーベース	6,298,100	6,309,800	6,298,000	6,383,700	6,386,200
										無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.032%	▲0.053%	▲0.052%	▲0.052%
										コール市場残高	182,062	176,381	170,040	165,623	165,275
										うち無担	150,829	142,981	137,596	134,922	133,860
										うちO/N	76,721	69,943	68,320	66,136	64,854
										うち有担	31,233	33,400	32,444	30,701	31,415

●オペ結果

種類	オフター (億円) 百万円	スタート日	エンド日	貸付 利率*	応札総額 (億円) 百万円	落札総額 (億円) 百万円	競争レート ・利回総差 ・償付総差	金取レート ・利回総差 ・償付総差	平均競争レート ・利回総差 ・償付総差	競争 比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2022/9/22	2022/9/26	▲ 0.350	12,402	12,402		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2022/9/22	2022/9/26	▲ 0.350	150	150		▲ 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		2022/9/26		0.000	3,713	3,713				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/26		0.035	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		2022/9/26		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)※4		2022/9/26		0.035	0	0				

●日銀政策決定会合・結果

●当分の金融政策運営について
1. わが国の金融環境は、全体として緩化した状態にある。新型コロナウイルス感染症の影響は、中小企業等の一部にお残存しているものの、これらの中小企業等の資金繰りも改善方向にある。こうした情勢を踏まえ、日本銀行は、本日の政策委員会・金融政策決定会合において、新型コロナウイルス対応金融支援特別オペを段階的に終了しつつ、幅広い資金繰りニーズに応える資金供給による対応に移行していくことを決定した(全員一致)。
(1) 新型コロナウイルス対応金融支援特別オペの取り扱い
① 感染症対応にかかる中小企業等向けのプロパー融資分は、期限を半年間延長し、2023年3月末に終了することとする。この間、毎月1回、3か月物の資金供給を実施する。
② 感染症対応にかかる中小企業等向けの制度融資分は、期限を3か月間延長し、2022年12月末に終了することとする。この間、毎月1回、3か月物の資金供給を実施する。
(2) 金額無制限の共通担保資金供給オペの実施
上記オペの期限到来後も中小企業等の資金繰りを支えるとともに、より幅広い資金繰りニーズに応える観点から、幅広い担保を裏付けとして資金を供給している「共通担保資金供給オペ」について、金額に上限を設けずに実施することとする(9月27日に予定している次回実施分から変更)。
2. 金融市場調節方針、資産買入れ方針については以下のとおりとする。
(1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(全員一致)
① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。
短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
② 連続指値オペの運用
上記の金融市場調節方針を実現するため、10年物国債金利について0.25%の利回りで指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。
(2) 資産買入れ方針(全員一致)
長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
① E T FおよびJ-R-E I Tについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
② CP等、社債等については、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(CP等: 約2兆円、社債等: 約3兆円)へと徐々に戻していく。

◆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