

Central Daily Market Report

2022年9月26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9月26日 需給速報	2022年9月27日 需給予想	2022年9月28日 当社予想
銀行券	300	400	▲ 1,000
財政	33,400	▲ 36,000	▲ 17,000
資金過不足	33,700	▲ 35,600	▲ 18,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 7,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		1,000	
国債買入	3,700	16,000	
CP等買入		▲ 500	▲ 600
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入			▲ 300
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ			
E T F買入			▲ 287,700
国債補充供給	▲ 10,800	12,600	10,800
※ドル資金供給用担保提供開始			
当預増減	38,700	▲ 8,700	▲ 313,000
当座預金残高	5,180,500	5,171,800	4,858,800
準備預金残高	4,543,700		
積み終了先	4,542,300		9月27日以降の残り所要積立額
超過準備	4,542,200		積数 11,900
非準備預金先	636,800		1日平均 600
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	99.68%	日数 36.67%

●2022年9月26日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、前営業日に市場残高額が増加した影響により、ビッド水準がやや低下して始まった。序盤は、邦銀業態を中心に▲0.065~▲0.055%での出会いとなった。一巡後は、ビッド数が徐々に減少し閑散となる中、▲0.08%台まで出会いが見られた。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、▲0.09~▲0.08%程度での出会い。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>

26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、全取利回り較差+0.013%と、弱めの結果となった。短国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発行市場は案件が乏しく、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

2022/9/26	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.063				-	▲ 0.085	0.245	0.010	26,431.55	▲ 722.28	143.52-54	143.82-84
T/N			▲ 0.065				-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	0.000	0.080	0.011				-	▲ 0.134						
2W							-	▲ 0.129						
3W							-	▲ 0.129						
1M							-	▲ 0.128						
3M							▲ 0.238	▲ 0.130						
6M							▲ 0.235	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.148	▲ 0.144						
									日付	9/15	9/16	9/20	9/21	9/22
									日銀当預残	5,060,100	5,048,000	5,133,400	5,135,600	5,141,800
									準備預金残	4,458,200	4,423,400	4,494,900	4,495,900	4,511,400
									マネタリーベース	6,309,800	6,298,000	6,383,700	6,386,200	6,393,200
									無担O/N加重平均	▲ 0.032%	▲ 0.053%	▲ 0.052%	▲ 0.052%	▲ 0.055%
									コール市場残高	176,381	170,040	165,623	165,275	179,424
									うち無担	142,981	137,596	134,922	133,860	148,242
									うちO/N	69,943	68,320	66,136	64,854	79,085
									うち有担	33,400	32,444	30,701	31,415	31,182

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/9/27			6,100	1,000		0.013	0.013	
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/9/27			13,024	4,756	0.007		0.009	31.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/9/27			10,240	4,752	0.018		0.019	72.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/9/27			11,738	5,508	0.022		0.028	22.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/26	2022/9/27	▲ 0.350	10,686	10,686		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/26	2022/9/27	▲ 0.350	50	50		▲ 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		2022/9/27		0.015	852	852				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/27		0.069	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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367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9月27日の予定

*8月の企業向けサービス価格指数	*8月の米耐久財新規受注	*40年利付国債入札 (7,000億円、9/28発行)
	*7月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	
	*9月の米CB消費者信頼感指数	
	*8月の米新築一戸建て販売件数	

◆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