

# Central Daily Market Report

2022年9月27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9月27日 需給速報	2022年9月28日 需給予想	2022年9月29日 当社予想
銀行券	500	200	▲ 500
財政	▲ 36,800	▲ 18,000	▲ 2,000
<b>資金過不足</b>	<b>▲ 36,300</b>	<b>▲ 17,800</b>	<b>▲ 2,500</b>
<b>金融調節</b>	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		11,300	▲ 7,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	1,000		
国債買入	16,000	3,900	
CP等買入		▲ 600	▲ 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	
新型コロナウイルス対応金融支援特別		73,000	▲ 287,700
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 13,200	10,800	13,200
※ドル資金供給用担保提供枠			
<b>当預増減</b>	<b>▲ 22,600</b>	<b>▲ 212,000</b>	<b>▲ 2,500</b>
当座預金残高	5,157,900	4,945,900	4,943,400
準備預金残高	4,514,700		
積み終了先	4,514,300		9月28日以降の残り所要積立額
超過準備	4,513,800		積数 11,000
非準備預金先	643,200		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 99.71%	日数 40.00%	

## ●2022年9月27日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き軟調な地合いとなり、レート水準は一段と低下する展開となった。序盤は、邦銀業態を中心に▲0.075~▲0.065%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、10月スタートの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>

27日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。また、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.002%、平均落札レート0.031%と、前回(按分0.002%・平均0.005%)比で按分レートは横ばい、平均レートは上昇となった。

## ●2022年9月28日の予定

\*金融政策決定会合議事要旨(7月20、21日分)  
\*7月の景気動向指数改訂状況

## ●短期金融市場関連指標

2022/9/27	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.069					-	▲ 0.087	0.250	0.005	26,571.87	140.32	144.46-48	144.26-28
T/N								-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W	0.001	0.008	0.002					-	▲ 0.136						
2W								-	▲ 0.131						
3W								-	▲ 0.130						
1M								-	▲ 0.129						
3M								▲ 0.250	▲ 0.129						
6M								▲ 0.235	▲ 0.149						
1Y								▲ 0.144	▲ 0.144						
										日付	9/16	9/20	9/21	9/22	9/26
										日銀当預残	5,048,000	5,133,400	5,135,600	5,141,800	5,180,500
										準備預金残	4,423,400	4,494,900	4,495,900	4,511,400	4,543,700
										マネタリーベース	6,298,000	6,383,700	6,386,200	6,393,200	6,431,600
										無担O/N加重平均	▲0.053%	▲0.052%	▲0.052%	▲0.055%	▲0.063%
										コール市場残高	170,040	165,623	165,275	179,424	167,709
										うち無担	137,596	134,922	133,860	148,242	136,439
										うちO/N	68,320	66,136	64,854	79,085	69,092
										うち有担	32,444	30,701	31,415	31,182	31,270

## ●入札結果

名称	回数	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非償額競争入札(億円)
40年利付国債	15	1.000%	7,000	2022/9/28	2062/3/20	16,529.0	6,995.00	84.6100	1.5200%	85.7142%			

## ●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>		2022/9/28	2022/10/12		11,250	11,250				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	1,500	2022/9/28			5,202	1,503	0.017		0.020	85.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2022/9/28			2,123	1,002	0.040		0.045	31.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/27	2022/9/28	▲ 0.350	13,138	13,138		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/27	2022/9/28	▲ 0.350	9	9		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2022/9/29	2022/10/6	3.340	0	0				
CP等買入	4,000	2022/9/30			7,990	3,990	0.002		0.031	11.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/9/28		0.005	1,474	1,474				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/28		0.020	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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
新型コロナウイルス対応金融支援特別 制度融資分	2022/9/28	2023/3/31	0	21,779
新型コロナウイルス対応金融支援特別 プロパー融資分	2022/9/28	2023/3/31	0	51,241

(参考) 2022/9/28時点の貸出残高(億円)	
制度融資分(2022/4/1以降実行)	48,265
プロパー融資分(2022/4/1以降実行)	59,741
2022/3/31以前に実行された貸付け	0
合計	108,006

◆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