

Central Daily Market Report

2022年9月28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9月28日 需給速報		2022年9月29日 需給予想		2022年9月30日 当社予想	
銀行券	200		▲ 500		▲ 900	
財政	▲ 21,100		▲ 1,200		3,000	
資金過不足	▲ 20,900		▲ 1,700		2,100	
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	11,300	▲ 7,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	3,900		2,500			
CP等買入		▲ 600		▲ 500	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
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	▲ 14,700	13,200		14,700		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	▲ 229,800		15,000		6,100	
当座預金残高	4,928,100		4,943,100		4,949,200	
準備預金残高	4,294,500					
積み終了先	4,294,000		9月29日以降の残り所要積立額		積数 10,500	
超過準備	4,294,000				1日平均 600	
非準備預金先	633,600					
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	99.72%	日数	43.33%		

●2022年9月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、一部で積極的な資金調達を行う先も見られたため、レート水準は前日比でやや上昇する展開となった。序盤は邦銀業態を中心に▲0.070~▲0.060%での出会いとなった。一巡後は、▲0.080~▲0.070%を中心に散發的な出会いが見られた。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>

28日のアウトライト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、月末発行にあたり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。

●短期金融市場関連指標

2022/9/28	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	▲ 0.068				-	▲ 0.087	0.245	▲ 0.005	26,173.98	▲ 397.89	144.70-71	144.55-58
T/N							-	▲ 0.092						
S/N			▲ 0.055				-	-						
1W	0.000	0.001	0.001				-	▲ 0.138						
2W	▲ 0.060	▲ 0.035	▲ 0.044				-	▲ 0.132						
3W							-	▲ 0.130						
1M							-	▲ 0.129						
3M			0.005				▲ 0.250	▲ 0.129						
6M							▲ 0.235	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.143						
									日付	9/20	9/21	9/22	9/26	9/27
									日銀当預残	5,133,400	5,135,600	5,141,800	5,180,500	5,157,900
									準備預金残	4,494,900	4,495,900	4,511,400	4,543,700	4,514,700
									マネタリーベース	6,383,700	6,386,200	6,393,200	6,431,600	6,408,600
									無担O/N加重平均	▲ 0.052%	▲ 0.052%	▲ 0.055%	▲ 0.063%	▲ 0.069%
									コール市場残高	165,623	165,275	179,424	167,709	168,233
									うち無担	134,922	133,860	148,242	136,439	136,677
									うちO/N	66,136	64,854	79,085	69,092	68,430
									うち有担	30,701	31,415	31,182	31,270	31,556

●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	募入最高利回り	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	第1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)	投分レート・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	投分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/28	2022/9/29	▲ 0.350	14,628	14,628		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/28	2022/9/29	▲ 0.350	1	1		▲ 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		2022/9/29		0.000	2,481	2,481				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/29		0.010	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。

●2022年9月29日の予定

*4-6月期の米GDP確報値	*2年利付国債入札 (28,000億円、10/3発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、10/11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