

Central Daily Market Report

2022年9月29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29日 需給速報	2022年9月30日 需給予想	2022年10月3日 当社予想			
銀行券	▲ 600	700	1,000			
財政	▲ 1,800	3,800	▲ 22,500			
資金過不足	▲ 2,400	4,500	▲ 21,500			
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	2,500	8,700				
CP等買入	▲ 500	4,000	▲ 4,100			
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 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 18,000	14,700	18,000			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 3,700	31,100	▲ 21,500			
当座預金残高	4,924,400	4,955,500	4,934,000			
準備預金残高	4,290,800					
積み終了先	4,290,400			9月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,290,400			積数	10,100	
非準備預金先	633,600			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	99.73%	日数	46.67%		

●2022年9月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き一部で積極的な資金調達を行う先が見られ、レート水準は前日比で僅かに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%を中心に散発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、9月末の取引となり一時的にレート水準が低下し、▲0.15~▲0.09%程度での出会いとなった。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>

29日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、期明け発行にあたり、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

2022/9/29	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	▲ 0.066				-	▲ 0.088	0.250	0.005	26,422.05	248.07	144.39-41	144.67-68
T/N							-	▲ 0.118						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.065	▲ 0.066				-	▲ 0.122						
2W			▲ 0.040				-	▲ 0.122						
3W							-	▲ 0.125						
1M	▲ 0.055	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.127						
3M			0.001				▲ 0.250	▲ 0.128						
6M							▲ 0.235	▲ 0.148						
1Y							▲ 0.144	▲ 0.143						
									日付	9/21	9/22	9/26	9/27	9/28
									日銀当預残	5,135,600	5,141,800	5,180,500	5,157,900	4,928,100
									準備預金残	4,495,900	4,511,400	4,543,700	4,514,700	4,294,500
									マネタリーベース	6,386,200	6,393,200	6,431,600	6,408,600	6,178,600
									無担O/N加重平均	▲0.052%	▲0.055%	▲0.063%	▲0.069%	▲0.068%
									コール市場残高	165,275	179,424	167,709	168,233	179,202
									うち無担	133,860	148,242	136,439	136,677	146,887
									うちO/N	64,854	79,085	69,092	68,430	80,190
									うち有担	31,415	31,182	31,270	31,556	32,315

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
2年利付国債	441	0.005%	28,000	2022/10/3	2024/10/1	107,757.0	22,548.0	100.0950	▲0.0420%	3.2510%	100.1030	▲0.0460%	5,446	
交付税特会	-	-	13,000	2022/10/11	2023/4/11	416,891.0	12,990.28		0.0000%	3.1160%		0.0000%		10.00

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/29	2022/9/30	▲0.350	17,936	17,936		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/29	2022/9/30	▲0.350	73	73		▲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		2022/9/30		0.005	8,750	8,750				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/30		0.020	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30日の予定

*月例経済報告	*8月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*8月の米個人所得・消費支出	*国庫短期証券(1111回)入札
*8月の有効求人倍率(市場予想:1.3倍)		*9月のシカゴPM景況感指数	(3ヶ月、56,000億円、10/3発行)
*8月の商業動態統計速報		*9月のユーロ圏消費者物価指数速報値	
*8月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.2%)		*4-6月期の英GDP確報値	
*9月の消費動向調査	*8月の住宅着工統計		

◆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