

Central Daily Market Report

2022年9月30日(金)
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30日 需給速報		2022年10月3日 需給予想		2022年10月4日 当社予想	
銀行券	800		400		1,000	
財政	6,100		▲ 29,500		▲ 38,000	
資金過不足	6,900		▲ 29,100		▲ 37,000	
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	8,700		12,700			
CP等買入	4,000	▲ 4,100		▲ 200		
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	▲ 27,600	18,000		27,600		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	5,900		11,000		▲ 37,000	
当座預金残高	4,930,300		4,941,300		4,904,300	
準備預金残高	4,326,300					
積み終了先	4,326,000		10月3日以降の残り所要積立額		積数 3,400	
超過準備	4,324,100		1日平均		300	
非準備預金先	604,000					
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	99.91%	日数	56.67%		

●2022年9月30日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、四半期末の取引となり、一部で調達を見送る先も見られたことから、レート水準は前日比で低下となった。序盤は、邦銀業態を中心に▲0.087~▲0.070%近辺での出会いとなった。一巡後も朝方と同水準で散発的な出会いが見られた。ターム物は、10月スタートのショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.09%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>

30日はTB3M物(第1111回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、強含んで推移した。

<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。発行レートは、概ね幅広い圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/9/30	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	▲ 0.073				-	▲ 0.091	0.245	▲ 0.005	25,937.21	▲ 484.84	144.41-43	144.31-33
T/N							-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.065	▲ 0.068				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.069	▲ 0.055	▲ 0.061				-	▲ 0.108						
3W							-	▲ 0.118						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.275	▲ 0.139						
6M							▲ 0.235	▲ 0.152						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.144						
									日付	9/22	9/26	9/27	9/28	9/29
									日銀当預残	5,141,800	5,180,500	5,157,900	4,928,100	4,924,400
									準備預金残	4,511,400	4,543,700	4,514,700	4,294,500	4,290,300
									マネタリーベース	6,393,200	6,431,600	6,408,600	6,178,600	6,175,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.055%	▲ 0.063%	▲ 0.069%	▲ 0.068%	▲ 0.066%
									コール市場残高	179,424	167,709	168,233	179,202	176,460
									うち無担	148,242	136,439	136,677	146,887	143,967
									うちO/N	79,085	69,092	68,430	80,190	78,260
									うち有担	31,182	31,270	31,556	32,315	32,493

●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1111	-	56,000	2022/10/3	2023/1/11	144,679.0	45,600.7	100.0565	▲ 0.2061%	98.8823%	100.0638	▲ 0.2327%	10,399.0

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/10/3			7,625	4,753	▲ 0.007		▲ 0.005	94.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/10/3			6,219	5,503	▲ 0.014		▲ 0.006	15.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/10/3			4,062	1,251	▲ 0.005		▲ 0.004	84.0
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/10/3			1,759	504	▲ 0.019		▲ 0.017	20.4
国債買入(物価連動債)	600	2022/10/3			2,208	600	▲ 0.420		▲ 0.467	43.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/30	2022/10/3	▲ 0.350	27,451	27,451		▲ 0.350	▲ 0.352	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/30	2022/10/3	▲ 0.350	105	105		▲ 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		2022/10/3		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)※2		2022/10/3		0.025	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10月3日の予定

*9月調査の日銀短観(概要及び要旨)	*9月のISM 製造業景況指数
*決定会合における主な意見(9月21・22日分)	*8月の米建設支出

◆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