

# Central Daily Market Report

2023年9月22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	2023年9月22日 需給速報	2023年9月25日 需給予想	2023年9月26日 当社予想	
銀行券	0	600	▲ 500	
財政	▲ 7,900	12,300	▲ 3,000	
資金過不足	▲ 7,900	12,900	▲ 3,500	
金融調節	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				
CP等買入	▲ 700	▲ 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			▲ 200	
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補充供給	▲ 37,400	36,600	37,400	
当預増減	▲ 9,400	49,900	▲ 3,500	

当座預金残高	5,481,600	5,531,500	5,528,000
準備預金残高	4,796,300		
積み終了先	4,793,700	9月25日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,793,300	積数	28,400
非準備預金先	685,300	1日平均	1,400

積み期間(9/16~10/15)の所要準備額 3,882,600

準備預金進捗率 実績 99.27% 日数 30.00%

## ●短期金融市場関連指標

2023/9/22	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	
	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	▲ 0.039				-	▲ 0.208	0.741	▲ 0.004	32,402.41	▲ 168.62	147.65-66	148.26-28
T/N							-	▲ 0.289						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.015	▲ 0.023				-	▲ 0.323						
2W							-	▲ 0.274						
3W							-	▲ 0.242						
1M							-	▲ 0.213						
3M							▲ 0.185	▲ 0.153						
6M							▲ 0.155	▲ 0.127						
1Y							▲ 0.064	▲ 0.081						

日付	9/14	9/15	9/19	9/20	9/21
日銀当預残	5,413,000	5,435,300	5,439,400	5,471,900	5,491,000
準備預金残	4,784,500	4,748,100	4,740,900	4,775,000	4,783,900
マネタリーベース	6,668,200	6,690,200	6,693,800	6,725,900	6,745,400
無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.043%	▲ 0.059%	▲ 0.056%	▲ 0.049%
コール市場残高	165,728	177,470	202,699	201,647	209,937
うち無担	137,037	147,631	173,435	173,732	182,306
うちO/N	66,919	78,403	100,727	94,754	99,483
うち有担	28,691	29,839	29,264	27,915	27,631

## ●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(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/9/25		0.255	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		2023/9/25		0.480	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/9/22	2023/9/25	▲ 0.450	38,084	38,084		▲ 0.450	▲ 0.451	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/9/25		0.255	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※4		2023/9/25		0.480	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/9/22	2023/9/25	▲ 0.450	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371回の買入利回りは、1.000%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361回の買入利回りは、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。  
※3固定利回較差の結果、10年利付国債371回の買入利回りは、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。  
※4固定利回較差の結果、10年利付国債361回の買入利回りは、1.000%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

## ●日銀政策決定会合・結果

### ●当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。

(1)長短金利操作(イールドカーフ・コントロール)

①次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする(全員一致)。

短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

(2)長短金利操作の運用(全員一致)

長期金利の変動幅は「±0.5%程度」を目途とし、長短金利操作について、より柔軟に運用する。10年物国債金利について1.0%の利回りでの指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。上記の金融市場調節方針と整合的なイールドカーフの形成を促すため、大規模な国債買入れを継続するとともに、各年限において、機動的に、買入れ額の増額や指値オペ、共通担保資金供給オペなどを実施する。

(2)資産買入れ方針(全員一致)

長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。

①ETFおよびJ-R E I Tについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。

②CP等は、約2兆円の残高を維持する。社債等は、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(約3兆円)へと徐々に戻していく。ただし、社債等の買入れ残高の調整は、社債の発行環境に十分配慮して進めることとする。

◆本資料は信頼できるとさ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