Central Daily Market Report

2022年9月1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1日 需給速報	2022年9月2日 需給予想	2022年9月5日 当社予想
銀行券	▲ 200	0	1,500
財政	▲ 39,000	▲ 50,100	3,000
資金過不足	▲ 39,200	▲ 50,100	4,500

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	12,400					
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
貸出支援基金（成）				▲ 2,400		
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						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 6,200	6,000		6,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 27,300		▲ 46,700		4,500	

当座預金残高	5,169,300	5,122,600	5,127,100
準備預金残高	4,511,900		
積み終了先	4,511,800		
超過準備	4,511,800		
非準備預金先	657,400		

9月2日以降の残り所要積立額	
積数	700
1日平均	100

積み期間（8/16～9/15）の所要準備額			3,873,500
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数 54.84%

●2022年9月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.05～▲0.025%の出合いで始まった。月末要因が剥落したものの、引き続き調達に慎重な姿勢が見られた。一巡後はレート水準が低下し、▲0.07～▲0.04%台の出合いが散見された。ターム物は、月内物の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095～▲0.085%程度での出合い。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>

1日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。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

2022/9/1	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.044				－	▲ 0.093
T/N	▲ 0.045	▲ 0.029	▲ 0.040				－	▲ 0.097
S/N							－	－
1W			▲ 0.040				－	▲ 0.105
2W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.039				－	▲ 0.109
3W							－	▲ 0.118
1M							－	▲ 0.132
3M							▲ 0.118	▲ 0.128
6M							▲ 0.210	▲ 0.147
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.235	0.015	27,661.47	▲ 430.06	139.32-34	139.28-29

日付	8/25	8/26	8/29	8/30	8/31
日銀当預残	5,396,000	5,391,700	5,388,900	5,383,200	5,196,600
準備預金残	4,716,200	4,715,700	4,714,200	4,706,600	4,542,500
マネタリーベース	6,649,300	6,645,200	6,642,100	6,636,500	6,449,900
無担O/N加重平均	▲0.038%	▲0.039%	▲0.039%	▲0.039%	▲0.041%
コール市場残高	170,056	172,398	172,977	173,082	164,137
うち無担	139,909	144,044	144,259	144,505	136,535
うちO/N	62,671	65,026	66,031	66,517	65,692
うち有担	30,147	28,354	28,718	28,577	27,602

●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Ｉ非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	367	0.200%	27,000	2022/9/2	2032/6/20	87,847.0	21,887.00	99.6200	**0.2390%**	**66.2307%**	99.6600	**0.2350%**	5,100.0	4.60

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/9/1	2022/9/2	▲ 0.350	6,099	6,099		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/9/1	2022/9/2	▲ 0.350	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/9/2		0.030	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		2022/9/2		0.111	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※3		2022/9/2		0.085	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
※2固定利回較差の結果、10年利付国債356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。※3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2日の予定

*8月のマネタリーベース
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
*8月の米雇用統計
*7月の米製造業新規受注・出荷・在庫
*国庫短期証券(1105回)入札
（3ヶ月、56,000億円、9/5発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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