

# Central Daily Market Report

2022年9月2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2日 需給速報		2022年9月5日 需給予想		2022年9月6日 当社予想	
銀行券	100		900		▲ 1,000	
財政	▲ 48,400		▲ 8,800		10,500	
資金過不足	▲ 48,300		▲ 7,900		9,500	
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			10,900			
CP等買入		▲ 400		▲ 300		
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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 6,700	6,200		6,700		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	▲ 51,600		9,400		9,500	
当座預金残高	5,117,700		5,127,100		5,136,600	
準備預金残高	4,464,000					
積み終了先	4,463,900		9月5日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,463,900		積数		400	
非準備預金先	653,700		1日平均		0	
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	99.99%	日数	64.52%		

## ●2022年9月2日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、マーケットでのオファー金額が増加した影響により、週末ではあったもののレート水準は低下する展開となった。立ち上がりは、国内勢を中心に▲0.055~▲0.035%での調達が見られた。一巡後は、▲0.05%近辺で散発的な出合いが見られた。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.080%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>

2日はTB3M物(第1105回)の入札が実施され、事前予想通り無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調な推移となった。

### <CP市場>

CP発行市場は、小口の案件が数件見られた程度で、閑散とした展開となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/9/2	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.048				-	▲ 0.092	0.235	0.000	27,650.84	▲ 10.63	140.08-10	140.24-26
T/N	▲ 0.055	▲ 0.030	▲ 0.050				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	0.005	▲ 0.040				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.050	▲ 0.025	▲ 0.042				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.115	▲ 0.127						
6M							▲ 0.210	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144						
									日付	8/26	8/29	8/30	8/31	9/1
									日銀当預残	5,391,700	5,388,900	5,383,200	5,196,600	5,169,300
									準備預金残	4,715,700	4,714,200	4,706,600	4,542,500	4,511,900
									マネタリーベース	6,645,200	6,642,100	6,636,500	6,449,900	6,422,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.039%	▲ 0.039%	▲ 0.041%	▲ 0.044%
									コール市場残高	172,398	172,977	173,082	164,137	179,867
									うち無担	144,044	144,259	144,505	136,535	150,689
									うちO/N	65,026	66,031	66,517	65,692	68,076
									うち有担	28,354	28,718	28,577	27,602	29,178

## ●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	募入最高利率・利回較差	棄分率	募入平均価格	募入平均利率・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1105	-	56,000	2022/9/5	2022/12/5	147,064.0	45,400.5	100.0265	▲ 0.1062%	74.5250%	100.0274	▲ 0.1098%	10,599.0

## ●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1年超3年以下)	4,750	2022/9/5			8,122	4,756	0.001		0.004	52.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/9/5			8,678	4,753	0.010		0.012	12.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/9/5			3,503	1,254	0.021		0.024	11.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/2	2022/9/5	▲ 0.350	6,605	6,605		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/2	2022/9/5	▲ 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		2022/9/5		0.015	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		2022/9/5		0.100	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		2022/9/5		0.075	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。 ※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5日の予定

\*9月の日銀当座預金増減要因見込み

\*New York祝日(Labor Day)

◆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