Central Daily Market Report

2022年9月6日（火）
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6日 需給速報		2022年9月7日 需給予想		2022年9月8日 当社予想	
銀行券	800		600		500	
財政	13,800		▲ 10,600		▲ 2,000	
資金過不足	14,600		▲ 10,000		▲ 1,500	
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			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 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	▲ 7,500	7,200		7,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	14,200		▲ 1,500		▲ 1,500	

当座預金残高	5,131,700	5,130,200	5,128,700
準備預金残高	4,498,400		
積み終了先	4,498,300	9月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,498,300	積数	300
非準備預金先	633,300	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	70.97%

●2022年9月6日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O／N物は、邦銀業態を中心に▲0.055～▲0.03%の調達で始まった。レート水準の低下基調には一旦落ち着きが見られた事で、一巡後も同水準での出合いが継続された。タ―ム物は、ショートタ―ムでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.090～▲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>

6日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや甘めの結果となった。アウトライト市場で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、入札件数が少なく閑散としたマーケットとなった。発行レートは概ね横ばい圏で推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/9/6	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.043				－	▲ 0.087
T/N			▲ 0.040				－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.096
2W	▲ 0.005	▲ 0.003	▲ 0.004				－	▲ 0.103
3W							－	▲ 0.114
1M							－	▲ 0.134
3M							▲ 0.118	▲ 0.129
6M							▲ 0.210	▲ 0.147
1Y							▲ 0.165	▲ 0.145

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	0.005	27,626.51	6.90	140.42-44	141.53-55

日付	8/30	8/31	9/1	9/2	9/5
日銀当預残	5,383,200	5,196,600	5,169,300	5,117,700	5,117,500
準備預金残	4,706,600	4,542,500	4,511,900	4,464,000	4,475,000
マネタリーベース	6,636,500	6,449,900	6,422,800	6,371,000	6,370,100
無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.041%	▲0.044%	▲0.048%	▲0.047%
コール市場残高	173,082	164,137	179,867	185,900	173,542
うち無担	144,505	136,535	150,689	156,100	142,847
うちO/N	66,517	65,692	68,076	66,717	58,114
うち有担	28,577	27,602	29,178	29,800	30,695

●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)
30年利付国債	75	1.300%	9,000	2022/9/7	2052/6/20	23,748.0	7,244.00	101.3000	**1.2400%**	**13.8349%**	101.4100	**1.2350%**	1,747.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/9/7			4,085	1,000	0.015		0.015	79.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/9/6	2022/9/7	▲ 0.350	7,412	7,412		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/9/6	2022/9/7	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/9/8	2022/9/15	2.580	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		2022/9/7		0.020	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		2022/9/7		0.110	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		2022/9/7		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7日の予定

*8月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*7月の景気動向指数速報
*米ベージュブック
*7月の米貿易収支
*4-6月期のユーロ圏GDP確報値

◆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