

# Central Daily Market Report

2022年9月8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8日 需給速報	2022年9月9日 需給予想	2022年9月12日 当社予想			
銀行券	▲ 100	600	▲ 500			
財政	▲ 6,500	▲ 3,900	▲ 13,000			
資金過不足	▲ 6,600	▲ 3,300	▲ 13,500			
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	16,500	200				
CP等買入		▲ 200	▲ 700			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)		▲ 23,600				
被災地支援 社債等買入				▲ 100		
新型コロナウイルス対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 9,300	6,800	9,300			
※ドル資金供給用担保債提供額						
当預増減	▲ 16,400	5,400	▲ 13,500			
当座預金残高	5,105,800	5,111,200	5,097,700			
準備預金残高	4,491,100					
積み終了先	4,491,100			9月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,491,100			積数	200	
非準備預金先	614,700			1日平均	0	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					3,872,100	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	77.42%		

## ●2022年9月8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▲0.045~▲0.03%の調達で始まった。前日に比べ、レート水準を上昇させる先が増加し、一巡後も同水準で散発的な出会いが継続された。ターム物は、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、▲0.090~▲0.080%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>

8日はTB6M物(第1106回)の入札が実施され、テールが流れたものの前回債より強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、しっかりとした推移となった。

### <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

2022/9/8	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		
	単位：%	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.037					-	▲ 0.086	0.245	0.000	28,065.28	634.98	144.09-10	143.81-83
T/N			▲ 0.023					-	▲ 0.086						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.042	▲ 0.040	▲ 0.040					-	▲ 0.092						
2W								-	▲ 0.103						
3W								-	▲ 0.113						
1M								-	▲ 0.131						
3M								▲ 0.118	▲ 0.127						
6M								▲ 0.194	▲ 0.147						
1Y								▲ 0.165	▲ 0.145						
日付		9/1	9/2	9/5	9/6	9/7									
日銀当預残		5,169,300	5,117,700	5,117,500	5,131,700	5,122,200									
準備預金残		4,511,900	4,464,000	4,475,000	4,498,400	4,502,400									
マネタリーベース		6,422,800	6,371,000	6,370,100	6,383,400	6,373,400									
無担O/N加重平均		▲0.044%	▲0.048%	▲0.047%	▲0.043%	▲0.041%									
コール市場残高		179,867	185,900	173,542	175,899	174,308									
うち無担		150,689	156,100	142,847	144,434	142,133									
うちO/N		68,076	66,717	58,114	60,016	62,795									
うち有担		29,178	29,800	30,695	31,465	32,175									

## ●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	棄分率	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	1106	-	40,000	2022/9/12	2023/3/10	119,105.0	32,428.5	100.0770	▲0.1568%	2.1971%	100.0950	▲0.1935%	7,571.0
エネルギー対策	-	-	5,500	2022/9/20	2023/9/20	124,350.0	5,499.94	-	0.0000%	4.6278%	-	0.0000%	-
流動性供給	365	-	5,000	2022/9/9	-	24,439.0	4,991.0	-	▲0.0160%	88.4873%	-	▲0.0180%	-

## ●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)		2022/9/8	2022/9/9	▲ 0.350	9,025	9,025		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/8	2022/9/9	▲ 0.350	100	100		▲ 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		2022/9/9		0.005	225	225				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/9		0.081	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		2022/9/9		0.055	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9日の予定

*8月のマネーストック	*7月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1107回)入札 (3ヶ月、56,000億円、9/12発行)
*7月の特定サービス産業動態統計速報		

◆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