

# Central Daily Market Report

2022年9月9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9日 需給速報	2022年9月12日 需給予想	2022年9月13日 当社予想
銀行券	700	800	500
財政	▲ 5,100	▲ 17,300	▲ 500
資金過不足	▲ 4,400	▲ 16,500	0
<b>金融調節</b>	スタート	エンド	スタート
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	200	300	
CP等買入		▲ 400	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入		▲ 100	▲ 200
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	▲ 7,200	9,300	7,200
※ドル資金供給用担保提供増額			
当預増減	▲ 2,900	▲ 9,600	0
当座預金残高	5,102,900	5,093,300	5,093,300
準備預金残高	4,495,500		
積み終了先	4,495,500		9月12日以降の残り所要積立額
超過準備	4,495,500		積数
非準備預金先	607,400		1日平均
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	100.00%	日数
			87.10%

## ●2022年9月9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~▲0.018%の調達で始まった。今積み期間最後の週末3日積みとなった事で、取り上がる先も複数散見された。一巡後も同水準で散発的な出合いが継続された。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~▲0.075%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>

9日はTB3M物(第1107回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかりと推移した。

### <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。また、本日CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でおファーされた。結果は按分レート+0.002%、平均レート+0.005%と、前回(按分+0.001%、平均+0.022%)比で按分レートは上昇し、2回続けてプラス金利となり、平均レートでは低下となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/9/9	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.086	0.245	0.000	28,214.75	149.47	143.87-88	142.35-37
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.083						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.032				-	▲ 0.091						
2W			▲ 0.020				-	▲ 0.102						
3W							-	▲ 0.119						
1M							-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.124	▲ 0.129						
6M							▲ 0.230	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.145						
									日付	9/2	9/5	9/6	9/7	9/8
									日銀当預残	5,117,700	5,117,500	5,131,700	5,122,200	5,105,800
									準備預金残	4,464,000	4,475,000	4,498,400	4,502,400	4,491,100
									マネタリーベース	6,371,000	6,370,100	6,383,400	6,373,400	6,357,100
									無担O/N加重平均	▲0.048%	▲0.047%	▲0.043%	▲0.041%	▲0.037%
									コール市場残高	185,900	173,542	175,899	174,308	174,252
									うち無担	156,100	142,847	144,434	142,133	142,823
									うちO/N	66,717	58,114	60,016	62,795	64,990
									うち有担	29,800	30,695	31,465	32,175	31,429

## ●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	1107	-	56,000	2022/9/12	2022/12/12	133,885.0	45,400.10	100.0275	▲0.1102%	59.2911%	100.0288	▲0.1154%	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/9	2022/9/12	▲ 0.350	7,050	7,050		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/9	2022/9/12	▲ 0.350	0	0				
CP等買入	4,000	2022/9/14			13,485	3,990	0.002		0.005	29.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/9/12		0.005	327	327				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/12		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		2022/9/12		0.065	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12日の予定

\*特にありません

◆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