

Central Daily Market Report

2022年9月12日(月)
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12日 需給速報		2022年9月13日 需給予想		2022年9月14日 当社予想	
銀行券	800		500		1,000	
財政	▲ 16,700		▲ 14,200		▲ 25,000	
資金過不足	▲ 15,900		▲ 13,700		▲ 24,000	
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						▲ 10,700
全店共通						▲ 13,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	300		1,800			
CP等買入		▲ 400		▲ 100	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 200				
新型コロナウイルス対応 気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 6,000	7,200		6,000		
当増減	▲ 15,000		▲ 6,000		▲ 44,400	
当座預金残高	5,087,900		5,081,900		5,037,500	
準備預金残高	4,481,000					
積み終了先	4,481,000		9月13日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	4,481,000				0	
非準備預金先	606,900				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	100.00%	日数	90.32%		

●2022年9月12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▲0.05~▲0.02%の調達が見られた。調達サイドのビッドにバラツキがみられる中、レートは前営業日比で横ばいからやや低下で推移した。ターム物は、ショートタームで引き合いが見られた。

<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>

12日のアウトライ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、小口の案件を中心に複数の業態から発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/9/12	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			
	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)	為替(17時)		
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.032				-	▲ 0.084	0.245	0.000	28,542.11	327.36	142.56-58	142.76-78		
T/N			▲ 0.040				-	▲ 0.085								
S/N							-	-								
1W							-	▲ 0.091								
2W			0.100				-	▲ 0.100								
3W							-	▲ 0.124								
1M							-	▲ 0.129								
3M							▲ 0.124	▲ 0.128								
6M							▲ 0.230	▲ 0.150								
1Y							▲ 0.165	▲ 0.146								
											日付	9/5	9/6	9/7	9/8	9/9
											日銀当預残	5,117,500	5,131,700	5,122,200	5,105,800	5,102,900
											準備預金残	4,475,000	4,498,400	4,502,400	4,491,100	4,494,800
											マネタリーベース	6,370,100	6,383,400	6,373,400	6,357,100	6,353,500
											無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.043%	▲0.041%	▲0.037%	▲0.030%
											コール市場残高	173,542	175,899	174,308	174,252	188,622
											うち無担	142,847	144,434	142,133	142,823	157,143
											うちO/N	58,114	60,016	62,795	64,990	78,230
											うち有担	30,695	31,465	32,175	31,429	31,479

●入札結果

本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。

●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)		2022/9/12	2022/9/13	▲ 0.350	5,908	5,908		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/12	2022/9/13	▲ 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		2022/9/13		0.005	1,845	1,845				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/13		0.095	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		2022/9/13		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 ※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。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2022/9/14	2026/9/14	0	30,590

●2022年9月13日の予定

*8月の企業物価指数

*7-9月期の法人企業景気予測調査季報

*8月の米財政収支

*8月の米消費者物価指数

*5年利付国債入札

(25,000億円、9/14発行)

*食料安定供給借入

(117億円、9/22借入)

◆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