Central Daily Market Report

2022年9月13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13日 需給速報		2022年9月14日 需給予想		2022年9月15日 当社予想	
銀行券	500		100		▲ 1,500	
財政	▲ 15,300		▲ 34,800		▲ 2,400	
資金過不足	▲ 14,800		▲ 34,700		▲ 3,900	
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			7,300	▲ 13,700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	1,800					
CP等買入		▲ 100	4,000	▲ 700		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）			30,600	▲ 10,200		
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	▲ 6,200	6,000		6,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 13,300		▲ 10,200		▲ 3,900	

当座預金残高	5,074,600	5,064,400	5,060,500
準備預金残高	4,455,500		
積み終了先	4,455,400	9月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,455,400	積数	0
非準備預金先	619,100	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	93.55%

●2022年9月13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～▲0.015%の調達が見られた。地合いに大きな変化は無く、レートは前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>

13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。マーケットでは3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施され、一部の業態で大型発行も見られた。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

2022/9/13	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.033				－	▲ 0.086
T/N							－	▲ 0.089
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.003				－	▲ 0.094
2W							－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.126
1M							－	▲ 0.129
3M			0.040				▲ 0.120	▲ 0.128
6M							▲ 0.235	▲ 0.150
1Y							▲ 0.165	▲ 0.146

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）
0.240	▲ 0.005	28,614.63	72.52	142.58-59	142.25-26

日付	9/6	9/7	9/8	9/9	9/12
日銀当預残	5,131,700	5,122,200	5,105,800	5,102,900	5,087,900
準備預金残	4,498,400	4,502,400	4,491,100	4,494,800	4,480,900
マネタリーベース	6,383,400	6,373,400	6,357,100	6,353,500	6,337,700
無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.041%	▲0.037%	▲0.030%	▲0.032%
コール市場残高	175,899	174,308	174,252	188,622	172,855
うち無担	144,434	142,133	142,823	157,143	140,797
うちO/N	60,016	62,795	64,990	78,230	63,069
うち有担	31,465	32,175	31,429	31,479	32,058

●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)	非競争入札(億円)
5年利付国債	153	0.005%	25,000	2022/9/14	2027/6/20	76,685.0	20,247.0	99.8200	0.0420%	36.2922%	99.8300	0.0400%	4,732	10.00
食料安定供給	－	－	117	2022/9/22	2027/9/22	351.0	117.00		0.0000%	100.0000%		0.0000%		

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2022/9/14	2022/9/28		7,252	7,252				
国庫短期証券買入	1,000	2022/9/14			5,960	1,000	0.013		0.015	99.6
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/9/13	2022/9/14	▲ 0.350	6,162	6,162		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/9/13	2022/9/14	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/9/15	2022/9/22	2.580	3	3				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/9/14		0.005	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		2022/9/14		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		2022/9/14		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
※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14日の予定

*7月の機械受注統計（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲0.8%）　*8月の米生産者物価指数　*8月の英消費者物価指数

◆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