Central Daily Market Report

2022年9月14日(水)

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14日 需給速報		2022年9月15日 需給予想		2022年9月16日 当社予想	
銀行券	100		▲ 500		▲ 500	
財政	▲ 35,200		▲ 8,700		▲ 9,000	
資金過不足	▲ 35,100		▲ 9,200		▲ 9,500	
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	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			12,400			
CP等買入	4,000	▲ 700		▲ 300		
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				▲ 100		
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	▲ 15,200	6,200		15,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 25,800		18,000		▲ 9,500	
当座預金残高	5,048,800		5,066,800		5,057,300	
準備預金残高	4,436,700					
積み終了先	4,436,700		9月15日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,436,700		積数	0		
非準備預金先	612,100		1日平均	0		
積み期間（8/16～9/15）の所要準備額					3,872,000	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	96.77%		

●2022年9月14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～▲0.015%の調達が見られた。積み最終日に向けた調整も見られたことで、レートは前日比で横ばいからやや上昇で推移した。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>

14日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/9/14	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	▲ 0.040	▲ 0.038	▲ 0.039				－	▲ 0.091
S/N							－	－
1W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.045				－	▲ 0.097
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.038				－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.127
1M	▲ 0.050	0.250	0.020				－	▲ 0.130
3M							▲ 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)
0.250	0.010	27,818.62	▲ 796.01	144.42-44	143.30-33

日付	9/7	9/8	9/9	9/12	9/13
日銀当預残	5,122,200	5,105,800	5,102,900	5,087,900	5,074,600
準備預金残	4,502,400	4,491,100	4,494,800	4,480,900	4,454,200
マネタリーベース	6,373,400	6,357,100	6,353,500	6,337,700	6,324,000
無担O/N加重平均	▲0.041%	▲0.037%	▲0.030%	▲0.032%	▲0.033%
コール市場残高	174,308	174,252	188,622	172,855	175,338
うち無担	142,133	142,823	157,143	140,797	143,023
うちO/N	62,795	64,990	78,230	63,069	66,895
うち有担	32,175	31,429	31,479	32,058	32,315

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/9/15			8,240	4,753	0.000		0.004	39.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/9/15			13,340	5,507	0.027		0.031	93.3
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/9/15			1,634	502	0.019		0.022	89.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/14	2022/9/15	▲ 0.350	6,475	6,475		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/14	2022/9/15	▲ 0.350	7,254	7,254		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/14	2022/9/15	▲ 0.350	1,333	1,333		▲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		2022/9/15		0.010	1,598	1,598				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/15		0.125	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		2022/9/15		0.095	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15日の予定

*8月の貿易統計
*7月の第3次産業活動指数
*英中銀MPC結果発表
*8月の米小売売上高
*7月の米企業在庫
*8月の米鉱工業生産・設備稼働率
*国庫短期証券(1108回)入札
（1年、35,000億円、9/20発行）
*20年利付国債入札
（12,000億円、9/16発行）

◆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