

Central Daily Market Report

2022年9月16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16日 需給速報	2022年9月20日 需給予想	2022年9月21日 当社予想	
銀行券	▲ 300	▲ 200	1,000	
財政	▲ 14,200	88,500	▲ 18,000	
資金過不足	▲ 14,500	88,300	▲ 17,000	
金融調節	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	1,900	4,400		
CP等買入	▲ 300	▲ 500		
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援 社債等買入	▲ 300	▲ 300		
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	▲ 5,100	6,200	5,100	
※ドル資金供給用担保提供開始				
当預増減	▲ 12,100	97,000	▲ 17,000	
当座預金残高	5,048,000	5,145,000	5,128,000	
準備預金残高	4,421,700			
積み終了先	4,417,400	9月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,491,300	積数	29,200	
非準備預金先	626,300	1日平均	1,100	
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額			3,750,600	
準備預金進捗率	実績	99.22%	日数	13.33%

●2022年9月16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▲0.06~▲0.05%の調達が見られた。新積み期間初日かつ4日積みとなったことで、目線が定まりづらい中、調達サイドの目線は前日までのターム物の出合いを手掛かりとして▲0.05%台に多くのビッドが集まった。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、▲0.095~▲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>

16日はTB3M物(第1109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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/9/16	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	
	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.053				-	▲ 0.087	0.250	0.000	27,567.65	▲ 308.26	143.33-35	143.44-47
T/N			▲ 0.060				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.020				-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.067	▲ 0.025	▲ 0.051				-	▲ 0.123						
3W							-	▲ 0.128						
1M							-	▲ 0.128						
3M							▲ 0.128	▲ 0.127						
6M							▲ 0.224	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.145						
									日付	9/9	9/12	9/13	9/14	9/15
									日銀当預残	5,102,900	5,087,900	5,074,600	5,048,800	5,060,100
									準備預金残	4,494,800	4,480,900	4,454,200	4,436,600	4,458,200
									マネタリーベース	6,353,500	6,337,700	6,324,000	6,298,100	6,309,800
									無担O/N加重平均	▲ 0.030%	▲ 0.032%	▲ 0.033%	▲ 0.033%	▲ 0.032%
									コール市場残高	188,622	172,855	175,338	182,062	176,381
									うち無担	157,143	140,797	143,023	150,829	142,981
									うちO/N	78,230	63,069	66,895	76,721	69,943
									うち有担	31,479	32,058	32,315	31,233	33,400

●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	1109	-	56,000	2022/9/20	2022/12/19	133,662.0	45,400.5	100.0280	▲0.1135%	66.5675%	100.0291	▲0.1179%	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)		2022/9/16	2022/9/20	▲ 0.350	5,079	5,079		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/16	2022/9/20	▲ 0.350	20	20		▲ 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		2022/9/20		0.000	4,458	4,458				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/20		0.075	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		2022/9/20		0.050	0	0				
社債等買入	750	2022/9/22			1,602	750	0.063		0.143	83.8

*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。 ※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。 ※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。 ※4オペ結果

●2022年9月19日の予定

*敬老の日	*London休日(Funeral of Queen Elizabeth II)
-------	--

●2022年9月20日の予定

*8月の全国消費者物価指数(GPI)市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.7%	*米FOMC(1日目)
*4-6月期の資金循環統計速報	*8月の米住宅着工件数

◆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