

Central Daily Market Report

2022年9月20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20日 需給速報	2022年9月21日 需給予想	2022年9月22日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 200	2,000
財政	86,200	▲ 8,800	▲ 5,100
資金過不足	85,900	▲ 9,000	▲ 3,100
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	4,400	8,300	
CP等買入		▲ 500	▲ 100
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	800
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	▲ 9,200	5,100	9,200
当預増減	85,400	8,400	▲ 2,300
当座預金残高	5,133,400	5,141,800	5,139,500
準備預金残高	4,494,900		
積み終了先	4,491,200		
超過準備	4,490,800		
非準備預金先	638,500		
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	99.33%	日数
			16.67%

●2022年9月20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▲0.065~▲0.05%の出会いが中心となった。前営業日からの流れを引き継ぎ、比較的低めのレート水準でギブンされる地合いとなった。ターム物は、月内物の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、▲0.09~▲0.080%程度での出会い。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>

20日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で発行が実施され、一部で大型発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/9/20	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.052				-	▲ 0.087	0.250	0.000	27,688.42	120.77	143.17-20	143.46-48
T/N			▲ 0.055				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.008	▲ 0.034				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.060	▲ 0.055	▲ 0.057				-	▲ 0.130						
3W							-	▲ 0.130						
1M			0.005				-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.130	▲ 0.129						
6M							▲ 0.224	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.146						
									日付	9/12	9/13	9/14	9/15	9/16
									日銀当預残	5,087,900	5,074,600	5,048,800	5,060,100	5,048,000
									準備預金残	4,480,900	4,454,200	4,436,600	4,458,200	4,423,400
									マネタリーベース	6,337,700	6,324,000	6,298,100	6,309,800	6,298,000
									無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.033%	▲0.033%	▲0.032%	▲0.053%
									コール市場残高	172,855	175,338	182,062	176,381	170,040
									うち無担	140,797	143,023	150,829	142,981	137,596
									うちO/N	63,069	66,895	76,721	69,943	68,320
									うち有担	32,058	32,315	31,233	33,400	32,444

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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)		2022/9/20	2022/9/21	▲ 0.350	9,032	9,032		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/20	2022/9/21	▲ 0.350	8	8		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2022/9/22	2022/9/29	3.260	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		2022/9/21		0.000	8,361	8,361				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/21		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		2022/9/21		0.050	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。 ※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。

●2022年9月21日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合 (1日目、22日まで)	*米FOMC(2日目) *FRB 米経済見通し発表 *8月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1110回)入札 (3ヶ月、56,000億円、9/26発行) *流動性供給入札 (5,000億円、9/22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