

Central Daily Market Report

2022年9月21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21日 需給速報		2022年9月22日 需給予想		2022年9月26日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 900		▲ 1,000	
財政	▲ 8,700		▲ 800		32,000	
資金過不足	▲ 8,900		▲ 1,700		31,000	
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						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	8,300		15,200			
CP等買入		▲ 100		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			800	▲ 100		
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	▲ 6,300	9,200		6,300		
当増減	2,200		19,900		31,000	
当座預金残高	5,135,600		5,155,500		5,186,500	
準備預金残高	4,495,900					
積み終了先	4,492,900		9月22日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,492,500		積数		21,700	
非準備預金先	639,700		1日平均		900	
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		99.42%		日数	
					20.00%	

●2022年9月21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▲0.055~▲0.05%の出合いが中心となった。一巡後は、出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。ターム物は、期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~▲0.08%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>

21日は3M物(第1110回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでも、堅調な推移となった。1Y物と6M物では特段の出合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

2022/9/21	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	▲ 0.052				-	▲ 0.088	0.250	0.000	27,313.13	▲ 375.29	143.57-58	143.74-76
T/N			▲ 0.055				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.099						
2W			0.010				-	▲ 0.134						
3W							-	▲ 0.130						
1M							-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.220	▲ 0.130						
6M							▲ 0.224	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.146						
									日付	9/13	9/14	9/15	9/16	9/20
									日銀当預残	5,074,600	5,048,800	5,060,100	5,048,000	5,133,400
									準備預金残	4,454,200	4,436,600	4,458,200	4,423,400	4,494,900
									マネタリーベース	6,324,000	6,298,100	6,309,800	6,298,000	6,383,700
									無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.033%	▲0.032%	▲0.053%	▲0.052%
									コール市場残高	175,338	182,062	176,381	170,040	165,623
									うち無担	143,023	150,829	142,981	137,596	134,922
									うちO/N	66,895	76,721	69,943	68,320	66,136
									うち有担	32,315	31,233	33,400	32,444	30,701

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1110	-	56,000	2022/9/26	2023/1/6	127,241.0	45,400.7	100.0480	▲0.1716%	65.1557%	100.0535	▲0.1913%	10,599.0
流動性供給	366	-	5,000	2022/9/22	-	15,723.0	4,996.0	-	0.0100%	73.6035%	-	0.0080%	-

●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5年超10年以下)	1,500	2022/9/22			4,912	1,504	0.017		0.019	22.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2022/9/22			3,590	1,006	0.018		0.019	53.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/21	2022/9/22	▲ 0.350	6,269	6,269		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/21	2022/9/22	▲ 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		2022/9/22		0.000	12,637	12,637				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/22		0.049	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オファー。※2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22日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*英中銀MPC結果発表(9/15の延期分)
*黒田日銀総裁定例会見	

◆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