

# Central Daily Market Report

2022年9月5日(月)

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5日 需給速報	2022年9月6日 需給予想	2022年9月7日 当社予想
銀行券	800	700	500
財政	▲ 11,100	10,900	▲ 12,000
資金過不足	▲ 10,300	11,600	▲ 11,500
<b>金融調節</b>			
	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	10,900		
CP等買入		▲ 300	▲ 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			
新型コロナ対応金融支援特別			
気候変動対応オペ			
E T F買入			
国債補完供給	▲ 7,200	6,700	7,200
*ドル資金供給用担保提供開始			
当預増減	▲ 200	18,700	▲ 11,500
当座預金残高	5,117,500	5,136,200	5,124,700
準備預金残高	4,475,000		
積み終了先	4,474,900		
超過準備	4,474,900		
非準備預金先	642,500		
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			3,873,500
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			67.74%

## ●2022年9月5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~▲0.035%での調達で始まった。先週末と比べ、レート水準に大きな変化はなく、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られた。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

### <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>

5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、複数の業態から入札が実施された。発行レートは概ね幅広い圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/9/5	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.087	0.230	▲ 0.005	27,619.61	▲ 31.23	140.54-56	140.57-58
T/N	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.038				-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.097						
2W							-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.118	▲ 0.127						
6M							▲ 0.210	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144						
									日付	8/29	8/30	8/31	9/1	9/2
									日銀当預残	5,388,900	5,383,200	5,196,600	5,169,300	5,117,700
									準備預金残	4,714,200	4,706,600	4,542,500	4,511,900	4,464,000
									マネタリーベース	6,642,100	6,636,500	6,449,900	6,422,800	6,371,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.039%	▲ 0.041%	▲ 0.044%	▲ 0.048%
									コール市場残高	172,977	173,082	164,137	179,867	185,900
									うち無担	144,259	144,505	136,535	150,689	156,100
									うちO/N	66,031	66,517	65,692	68,076	66,717
									うち有担	28,718	28,577	27,602	29,178	29,800

## ●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	棄分率	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)		2022/9/5	2022/9/6	▲ 0.350	7,077	7,077		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/5	2022/9/6	▲ 0.350	32	32		▲ 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		2022/9/6		0.015	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		2022/9/6		0.090	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		2022/9/6		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けずオファー。 ※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6日の予定

*7月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比+4.2%)	*8月のISM 非製造業景況指数	*30年利付国債入札 (9,000億円、9/7発行)
*7月の毎月勤労統計調査速報		

◆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