

# Central Daily Market Report

2022年9月15日(木)  
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15日 需給速報		2022年9月16日 需給予想		2022年9月20日 当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 300		▲ 500	
財政	▲ 9,300		▲ 13,700		97,000	
資金過不足	▲ 9,700		▲ 14,000		96,500	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,400		1,900			
CP等買入		▲ 300		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 100		▲ 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	▲ 6,200	15,200		6,200		
当預増減	11,300		▲ 6,500		96,500	
当座預金残高	5,060,100		5,053,600		5,150,100	
準備預金残高	4,458,200					
積み終了先	4,458,200		9月16日以降の残り所要積立額		積数 3,750,600	
超過準備	4,458,200				1日平均 125,000	
非準備預金先	601,900					
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	0.00%	日数	0.00%		

## ●2022年9月15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▲0.04~▲0.015%の調達が見られた。積み最終日となり、必要量を確保した先から順次調達を終える展開となった。レートは前日比で概ね横ばいで最終日としては落ち着いた動きとなった。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>

15日はTB1Y物(第1108回)の入札が実施され、やや強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/9/15	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	▲ 0.032				-	▲ 0.084	0.250	0.000	27,875.91	57.29	142.91-93	143.56-58
T/N	▲ 0.059	▲ 0.050	▲ 0.055				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.055	0.005	▲ 0.048				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.055	▲ 0.003	▲ 0.033				-	▲ 0.105						
3W							-	▲ 0.129						
1M	0.014	0.200	0.034				-	▲ 0.130						
3M			0.010				▲ 0.120	▲ 0.128						
6M							▲ 0.224	▲ 0.151						
1Y							▲ 0.149	▲ 0.146						
									日付	9/8	9/9	9/12	9/13	9/14
									日銀当預残	5,105,800	5,102,900	5,087,900	5,074,600	5,048,800
									準備預金残	4,491,100	4,494,800	4,480,900	4,454,200	4,436,600
									マネタリーベース	6,357,100	6,353,500	6,337,700	6,324,000	6,298,100
									無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.030%	▲0.032%	▲0.033%	▲0.033%
									コール市場残高	174,252	188,622	172,855	175,338	182,062
									うち無担	142,823	157,143	140,797	143,023	150,829
									うちO/N	64,990	78,230	63,069	66,895	76,721
									うち有担	31,429	31,479	32,058	32,315	31,233

## ●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	1108	-	35,000	2022/9/20	2023/9/20	99,060.0	28,377.8	100.1340	▲0.1338%	17.4028%	100.1440	▲0.1437%	6,622.0
20年利付国債	181	0.900%	12,000	2022/9/16	2042/6/20	24,678.0	9,847.0	99.2500	0.9450%	96.6666%	100.0900	0.8940%	2,151.0

## ●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)		2022/9/15	2022/9/16	▲ 0.350	6,157	6,157		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/15	2022/9/16	▲ 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		2022/9/16		0.000	1,869	1,869				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/9/16		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		2022/9/16		0.062	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買入金額に制限を設けず。

## ●2022年9月16日の予定

*7月の石油等消費動態統計	*9月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *8月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(1109回) (3ヶ月、56,000億円、9/20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