

Central Daily Market Report

2022年8月3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8月3日 需給速報	2022年8月4日 需給予想	2022年8月5日 当社予想
銀行券	500	▲ 500	1,000
財政	▲ 79,800	2,500	9,000
資金過不足	▲ 79,300	2,000	10,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	2,100	▲ 2,300	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	1,000		12,400
国債買入			
CP等買入		▲ 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		▲ 200	
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	▲ 6,600	7,600	6,600
※ドル資金需給速報は前日速報を参照			
当増減	▲ 77,800	21,000	10,000
当座預金残高	5,308,400	5,329,400	5,339,400
準備預金残高	4,632,400		
積み終了先	4,632,300		8月4日以降の残り所要積立額
超過準備	4,632,300		積数
非準備預金先	676,000		1日平均
			0
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			3,870,200
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			61.29%

●2022年8月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、一部に調達ニーズが減退した先も見られたが、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、レート水準は高止まりとなっている。朝方は、▲0.010~▲0.008%近辺での出会いが見られた。一巡後も同水準で散発的な出会いが見られた。ターム物は、ショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.085%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>

3日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートは横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/8/3	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.040	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.095	0.185	0.015	27,741.90	147.17	133.32-34	133.21-23	
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.099							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.010				-	▲ 0.122							
2W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.019				-	▲ 0.128							
3W			▲ 0.008				-	▲ 0.136							
1M			▲ 0.030				-	▲ 0.141							
3M							▲ 0.142	▲ 0.147							
6M							▲ 0.215	▲ 0.151							
1Y							▲ 0.145	▲ 0.141							
									日付		7/27	7/28	7/29	8/1	8/2
									日銀当預残	5,514,700	5,512,500	5,407,100	5,402,100	5,386,200	
									準備預金残	4,842,500	4,828,700	4,728,200	4,718,800	4,702,900	
									マネタリーベース	6,765,900	6,765,000	6,659,700	6,654,300	6,638,300	
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.009%	
									コール市場残高	188,649	187,640	189,091	175,183	192,248	
									うち無担	159,401	158,529	161,095	149,121	165,153	
									うちO/N	83,318	82,181	86,977	79,033	90,885	
									うち有担	29,248	29,111	27,996	26,062	27,095	

●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	募入最高利回り	棄分率	募入平均価格	募入平均利回り	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*	応募総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	投分レート・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	投分比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2022/8/4			7,219	1,500	0.016		0.016	68.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/8/4			10,193	4,752	0.001		0.005	6.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/8/4			13,219	4,756	0.008		0.009	54.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/8/4			5,268	1,251	0.025		0.028	44.8
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2022/8/3	2022/8/4	▲ 0.350	6,514	6,514		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先・即日(午後オファー分))		2022/8/3	2022/8/4	▲ 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		2022/8/4		0.080	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		2022/8/4		0.221	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。

●2022年8月4日の予定

*英中銀MPC結果発表	*10年物価連動国債
*6月の米貿易収支	(2,500億円、8/5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