

Central Daily Market Report

2022年8月5日(金)

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5日 需給速報		2022年8月8日 需給予想		2022年8月9日 当社予想	
銀行券	0		100		▲ 500	
財政	5,400		3,800		▲ 1,000	
資金過不足	5,400		3,900		▲ 1,500	
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						
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
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	▲ 11,300	6,200		11,300		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	100		15,000		▲ 1,500	
当座預金残高	5,321,200		5,336,200		5,334,700	
準備預金残高	4,660,100					
積み終了先	4,660,100		8月8日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,660,100		積数		100	
非準備預金先	661,100		1日平均		0	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,873,200	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	74.19%		

●2022年8月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、週末要因により一部で取り上がる先も見られたが、大手行の調達動向に大きな変化が無かったことから、出会い水準は概ね横這い圏となった。朝方は、邦銀の調達を中心に▲0.010~▲0.008%近辺での出会いとなった。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、▲0.09~▲0.08%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>

5日はTB3M物(第1099回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、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あった。

●短期金融市場関連指標

2022/8/5	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.092	0.160	▲ 0.010	28,175.87	243.67	132.61-63	133.30-32
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.000	▲ 0.012				-	▲ 0.109						
2W			▲ 0.015				-	▲ 0.120						
3W							-	▲ 0.131						
1M							-	▲ 0.137						
3M							▲ 0.122	▲ 0.142						
6M							▲ 0.215	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.142						
									日付	7/29	8/1	8/2	8/3	8/4
									日銀当預残	5,407,100	5,402,100	5,386,200	5,308,400	5,321,100
									準備預金残	4,728,200	4,718,800	4,702,900	4,632,400	4,658,000
									マネタリーベース	6,659,700	6,654,300	6,638,300	6,560,100	6,573,200
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%
									コール市場残高	189,091	175,183	192,248	189,548	187,393
									うち無担	161,095	149,121	165,153	159,980	158,235
									うちO/N	86,977	79,033	90,885	83,847	82,442
									うち有担	27,996	26,062	27,095	29,568	29,158

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1099	-	56,000	2022/8/8	2022/11/7	122,738.0	45,400.2	100.0300	▲0.1202%	46.6848%	100.0324	▲0.1299%	10,599	
交付税特会	-	-	12,000	2022/8/19	2023/2/15	398,010.0	11,990.30	-	0.0000%	3.0126%	-	0.0000%	-	10.00

●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)		2022/8/5	2022/8/8	▲ 0.350	11,088	11,088		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/5	2022/8/8	▲ 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		2022/8/8		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		2022/8/8		0.220	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8日の予定

*6月の国際収支
*7月の景気ウォッチャー調査

◆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