

Central Daily Market Report

2022年8月12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12日 需給速報		2022年8月15日 需給予想		2022年8月16日 当社予想	
銀行券	▲ 500		400		500	
財政	▲ 3,000		71,500		1,000	
資金過不足	▲ 3,500		71,900		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	14,600					
CP等買入		▲ 500	4,000	▲ 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						
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	▲ 9,800	9,300		9,800		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	10,100		85,400		1,500	
当座預金残高	5,307,800		5,393,200		5,394,700	
準備預金残高	4,674,300					
積み終了先	4,674,300		8月15日以降の残り所要積立額		0	
超過準備	4,674,300		積数		0	
非準備預金先	633,500		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	96.77%		

●2022年8月12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3日積みの取引となった事もあり、引き続き調達ニーズの強い展開となった。朝方は、邦銀の調達を中心に▲0.009~▲0.006%が出合いの中心となった。一巡後はやや低下し、▲0.010~▲0.008%の水準で出合いが見られた。ターム物は、新しい積み期となる16日スタートの案件を中心に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>

12日はTB3M物(第1101回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかりと推移した。

<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、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/8/12	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	▲ 0.035	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.087	0.185	▲ 0.005	28,546.98	727.65	133.00-03	133.25-27
T/N							-	▲ 0.087						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.005	▲ 0.017				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.018	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.106						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.113						
1M	▲ 0.028	0.090	▲ 0.008				-	▲ 0.118						
3M							▲ 0.118	▲ 0.123						
6M							▲ 0.170	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.140						
									日付	8/4	8/5	8/8	8/9	8/10
									日銀当預残	5,321,100	5,321,200	5,326,700	5,321,400	5,297,700
									準備預金残	4,658,000	4,660,100	4,677,800	4,685,900	4,662,800
									マネタリーベース	6,573,200	6,573,300	6,578,600	6,573,500	6,550,500
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.008%
									コール市場残高	187,393	190,113	183,792	176,295	175,212
									うち無担	158,235	160,814	154,958	147,153	146,034
									うちO/N	82,442	83,971	77,815	70,210	71,606
									うち有担	29,158	29,299	28,834	29,142	29,178

●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	1101	-	56,000	2022/8/15	2022/11/14	179,572.0	45,400.40	100.0260	▲0.1042%	38.4144%	100.0281	▲0.1126%	10,599.0

●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)		2022/8/12	2022/8/15	▲ 0.350	9,661	9,661		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/12	2022/8/15	▲ 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		2022/8/15		0.060	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		2022/8/15		0.190	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15日の予定

*4-6月期のGDP1次速報(市場予想：前期比年率+2.5%)

◆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