

Central Daily Market Report

2022年8月15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8月15日 需給速報		2022年8月16日 需給予想		2022年8月17日 当社予想	
銀行券	400		200		500	
財政	69,500		▲ 1,000		▲ 28,000	
資金過不足	69,900		▲ 800		▲ 27,500	
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						▲ 2,100
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入	4,000	▲ 300		▲ 500		
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	▲ 10,400	9,800		10,400		
当預増減	73,000		9,100		▲ 29,600	
当座預金残高	5,380,800		5,389,900		5,360,300	
準備預金残高	4,742,900					
積み終了先	4,742,900		8月16日以降の残り所要積立額		積数 3,873,500	
超過準備	4,742,900				1日平均 125,000	
非準備預金先	637,900					
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	0.00%	日数	0.00%		

●2022年8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、積み最終日となり、着地に向けた調整から全般的に取り上げる展開となった。立ち上がりは邦銀・証券業態からの調達を中心に▲0.008~▲0.005%近辺での出合いが見られた。一巡後は、レート水準がやや低下し▲0.009~▲0.006%程度での出合いが中心となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.085%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発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2022/8/15	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	
	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	▲ 0.035	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.088	0.185	0.000	28,871.78	324.80	133.31-33	133.51-53
T/N	▲ 0.020	▲ 0.012	▲ 0.019				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.022	▲ 0.002	▲ 0.015				-	▲ 0.103						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.110						
1M	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018				-	▲ 0.116						
3M			0.005				▲ 0.120	▲ 0.123						
6M							▲ 0.170	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.141						
									日付	8/5	8/8	8/9	8/10	8/12
									日銀当預残	5,321,200	5,326,700	5,321,400	5,297,700	5,307,800
									準備預金残	4,660,100	4,677,800	4,685,900	4,662,800	4,674,300
									マネタリーベース	6,573,300	6,578,600	6,573,500	6,550,500	6,561,000
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.008%
									コール市場残高	190,113	183,792	176,295	175,212	168,672
									うち無担	160,814	154,958	147,153	146,034	139,031
									うちO/N	83,971	77,815	70,210	71,606	66,623
									うち有担	29,299	28,834	29,142	29,178	29,641

●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)		2022/8/15	2022/8/16	▲ 0.350	10,228	10,228		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/15	2022/8/16	▲ 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		2022/8/16		0.065	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		2022/8/16		0.185	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16日の予定

*6月の第3次産業活動指数	*7月の米住宅着工件数 *7月の米鉱工業生産・設備稼働率	*5年利付国債入札 (25,000億円、8/17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