Central Daily Market Report

2022年8月16日（火）
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16日 需給速報		2022年8月17日 需給予想		2022年8月18日 当社予想	
銀行券	300		100		▲ 500	
財政	▲ 1,800		▲ 27,500		▲ 1,500	
資金過不足	▲ 1,500		▲ 27,400		▲ 2,000	
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			5,000	▲ 2,100		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 10,300	10,400		10,300		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,900		▲ 13,200		▲ 2,000	

当座預金残高	5,378,900	5,365,700	5,363,700
準備預金残高	4,692,900		
積み終了先	3,338,200	8月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,338,000	積数	518,600
非準備預金先	686,000	1日平均	17,300
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 86.61%	日数	3.23%

●2022年8月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新しい積み期間に入った事によりレート目線が定まり辛く、調達に慎重となる先が多く見られた。朝方は、邦銀・証券業態などを中心に▲0.022～▲0.015%近辺での調達が見られた。レート水準は前日に比べやや低下し、一巡後も同水準で散発的な出合いとなった。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、▲0.085～▲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>

16日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、案件がなく、閑散としたマーケットとなった。

●短期金融市場関連指標

2022/8/16	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.045	0.001	▲ 0.018				－	▲ 0.086
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.088
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.030				－	▲ 0.096
2W	▲ 0.025	▲ 0.007	▲ 0.014				－	▲ 0.101
3W							－	▲ 0.107
1M	▲ 0.030	▲ 0.014	▲ 0.019				－	▲ 0.114
3M							▲ 0.120	▲ 0.121
6M							▲ 0.170	▲ 0.147
1Y							▲ 0.145	▲ 0.141

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.165	▲ 0.020	28,868.91	▲ 2.87	133.11-14	133.65-67

日付	8/8	8/9	8/10	8/12	8/15
日銀当預残	5,326,700	5,321,400	5,297,700	5,307,800	5,380,800
準備預金残	4,677,800	4,685,900	4,662,800	4,674,300	4,742,900
マネタリーベース	6,578,600	6,573,500	6,550,500	6,561,000	6,633,600
無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.007%
コール市場残高	183,792	176,295	175,212	168,672	161,375
うち無担	154,958	147,153	146,034	139,031	130,780
うちO/N	77,815	70,210	71,606	66,623	62,097
うち有担	28,834	29,142	29,178	29,641	30,595

●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Ｉ非価格競争入札(億円)
5年利付国債	153	0.005%	25,000	2022/8/17	2027/6/20	68,858.0	20,259.0	100.0400	**▲0.0030%**	**43.2300%**	100.0600	**▲0.0070%**	4,732.0

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2022/8/17	2022/8/31		4,950	4,950				
国庫短期証券買入	1,000	2022/8/17			4,347	1,001	0.026		0.027	85.3
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/8/16	2022/8/17	▲ 0.350	10,072	10,072		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/8/16	2022/8/17	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/8/18	2022/8/25	2.580	1	1				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/8/17		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		2022/8/17		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17日の予定

*6月の機械受注統計
（市場予想：船舶・電力除く民需、前月比+1.3%）
*7月の貿易統計
*7月の米小売売上高
*6月の米企業在庫
*4-6月期のユーロ圏GDP2次速報
*7月の英消費者物価指数
*国有林野借入
（961億円、8/25借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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