

Central Daily Market Report

2022年8月17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17日 需給速報	2022年8月18日 需給予想	2022年8月19日 当社予想				
銀行券	200	▲ 700	1,000				
財政	▲ 27,400	▲ 2,400	▲ 10,000				
資金過不足	▲ 27,200	▲ 3,100	▲ 9,000				
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			10,300				
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					400	▲ 2,900	
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ							
E T F買入							
国債補充供給	▲ 8,600	10,300		8,600			
※ドル資金供給用担保提供開始							
当預増減	▲ 21,600		15,700		▲ 11,500		
当座預金残高	5,357,300		5,373,000		5,361,500		
準備預金残高	4,675,300						
積み終了先	4,615,500					8月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,212,600					積数	55,900
非準備預金先	682,000					1日平均	1,900
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	98.56%	日数	6.45%			

●2022年8月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前日に比べレート水準がやや上昇となった。朝方は邦銀業態を中心に▲0.02~▲0.015%近辺での調達が見られた。一巡後は小幅に上昇し、▲0.017~▲0.013%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、▲0.085~▲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>

17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、複数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

2022/8/17	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.045	0.001	▲ 0.014					-	▲ 0.086	0.180	0.015	29,222.77	353.86	134.28-31	134.79-81
T/N			▲ 0.015					-	▲ 0.088						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018					-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.023	0.160	▲ 0.010					-	▲ 0.100						
3W			▲ 0.019					-	▲ 0.105						
1M	▲ 0.030	0.011	▲ 0.002					-	▲ 0.112						
3M								▲ 0.120	▲ 0.121						
6M								▲ 0.140	▲ 0.146						
1Y								▲ 0.130	▲ 0.141						
日付		8/9	8/10	8/12	8/15	8/16									
日銀当預残		5,321,400	5,297,700	5,307,800	5,380,800	5,378,900									
準備預金残		4,685,900	4,662,800	4,674,300	4,742,900	4,692,900									
マネタリーベース		6,573,500	6,550,500	6,561,000	6,633,600	6,631,400									
無担O/N加重平均		▲0.009%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.007%	▲0.018%									
コール市場残高		176,295	175,212	168,672	161,375	163,171									
うち無担		147,153	146,034	139,031	130,780	132,874									
うちO/N		70,210	71,606	66,623	62,097	65,991									
うち有担		29,142	29,178	29,641	30,595	30,297									

●入札結果

名称	回号	表見 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	導入最高利回・利回較差	乗分率	募入 平均価格	導入平均利回・利回較差	第1応募格 競争入札(億円)
国有林野借入	-	-	961	2022/8/25	2027/8/25	4,245.0	960.99	-	0.0000%	33.3340%	-	0.0000%	-

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/8/18			9,441	4,752	▲0.002		0.001	5.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/8/18			10,661	5,007	0.014		0.014	92.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/8/18			1,814	503	▲0.007		▲0.006	50.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/8/17	2022/8/18	▲ 0.350	8,438	8,438		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/17	2022/8/18	▲ 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		2022/8/18		0.085	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		2022/8/18		0.215	0	0				
社債等買入	750	2022/8/22			992	751	0.080		0.127	64.0

*オペの種類が、国債補充供給(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。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)	
被災地金融支援オペ	第17回	2022/8/19	2024/8/19	0	381

●2022年8月18日の予定

*7月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1102回)入札	*20年利付国債入札
*7月のユーロ圏消費者物価指数改定値	(1年、35,000億円、8/22発行)	(12,000億円、8/19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