

Central Daily Market Report

2022年8月18日(木)
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18日 需給速報		2022年8月19日 需給予想		2022年8月22日 当社予想	
銀行券	▲ 700		100		▲ 1,000	
財政	▲ 4,600		▲ 3,200		▲ 7,000	
資金過不足	▲ 5,300		▲ 3,100		▲ 8,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,300					
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援			400	▲ 2,900		
社債等買入					800	
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						
国債補完供給	▲ 8,300	8,600		8,300		
当預増減	5,200		2,600		▲ 7,200	
当座預金残高	5,362,500		5,365,100		5,357,900	
準備預金残高	4,681,900					
積み終了先	4,672,800		8月19日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,652,700		積数		26,800	
非準備預金先	680,600		1日平均		1,000	
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	99.31%	日数	9.68%		

●2022年8月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、レート水準が一段と上昇する展開となった。朝方は邦銀業態を中心に▲0.017~▲0.008%近辺での調達が見られた。一巡後は、レンジがやや縮小し▲0.016~▲0.01%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>

18日はTB1Y物(第1102回)の入札が実施され、強めの結果となった。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、複数の業態で発行が実施され、発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2022/8/18	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計	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	▲ 0.038	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.085	0.195	0.015	28,942.14	▲ 280.63	134.96-98	135.28-30
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.023	▲ 0.015	▲ 0.019				-	▲ 0.095						
2W	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.099						
3W							-	▲ 0.105						
1M			0.000				-	▲ 0.112						
3M							▲ 0.130	▲ 0.121						
6M							▲ 0.190	▲ 0.143						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.137						
									日付	8/10	8/12	8/15	8/16	8/17
									日銀当預残	5,297,700	5,307,800	5,380,800	5,378,900	5,357,300
									準備預金残	4,662,800	4,674,300	4,742,900	4,692,900	4,675,300
									マネタリーベース	6,550,500	6,561,000	6,633,600	6,631,400	6,609,600
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.008%	▲0.007%	▲0.018%	▲0.014%
									コール市場残高	175,212	168,672	161,375	163,171	164,057
									うち無担	146,034	139,031	130,780	132,874	133,331
									うちO/N	71,606	66,623	62,097	65,991	63,298
									うち有担	29,178	29,641	30,595	30,297	30,726

●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	募入額	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	1102	-	35,000	2022/8/22	2023/8/21	97,700.0	28,382.8	100.1310	▲0.1311%	81.7938%	100.1310	▲0.1311%	6,617.0
20年利付国債	181	0.900%	12,000	2022/8/19	2042/6/20	31,706.0	9,661.00	102.5000	0.7550%	67.4224%	102.5500	0.7520%	2,332.0

●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)		2022/8/18	2022/8/19	▲ 0.350	8,102	8,102		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/18	2022/8/19	▲ 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		2022/8/19		0.070	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		2022/8/19		0.205	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19日の予定

*7月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想：前年同月比(除く生鮮)+2.4%)	*国庫短期証券(1103回) (3ヶ月、56,000億円、8/22発行)
*6月の石油等消費動態統計	

◆本資料は信頼できるとさ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