

Central Daily Market Report

2022年8月23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23日 需給速報		2022年8月24日 需給予想		2022年8月25日 当社予想	
銀行券	▲ 100		100		▲ 1,000	
財政	▲ 5,500		▲ 6,600		37,000	
資金過不足	▲ 5,600		▲ 6,500		36,000	
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			1,000			
国債買入						
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						
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						
国債補充供給	▲ 9,100	9,400		9,100		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 5,300		3,500		36,000	
当座預金残高	5,348,000		5,351,500		5,387,500	
準備預金残高	4,667,100					
積み終了先	4,664,600		8月24日以降の残り所要積立額		積数 6,300	
超過準備	4,664,600		1日平均		300	
非準備預金先	680,900					
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	99.84%	日数	25.81%		

●2022年8月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.04~▲0.01%の出会いで始まった。レート水準が低下基調となる中、調達に慎重となる先も複数見られ、一巡後はやや低下し▲0.055~▲0.025%近辺での出会いとなった。ターム物は、ショートターム物の引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.085%程度での出会い。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>

23日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱めの結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/8/23	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.022				-	▲ 0.089	0.215	▲ 0.005	28,452.75	▲ 341.75	137.56-58	137.27-29
T/N			▲ 0.015				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.029				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.008	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.102						
3W			0.090				-	▲ 0.108						
1M							-	▲ 0.119						
3M							▲ 0.130	▲ 0.127						
6M							▲ 0.190	▲ 0.145						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.143						
									日付	8/16	8/17	8/18	8/19	8/22
									日銀当預残	5,378,900	5,357,300	5,362,500	5,356,300	5,353,300
									準備預金残	4,692,900	4,675,300	4,681,900	4,669,000	4,672,100
									マネタリーベース	6,631,400	6,609,600	6,615,500	6,609,100	6,605,500
									無担O/N加重平均	▲ 0.018%	▲ 0.014%	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.014%
									コール市場残高	163,171	164,057	169,645	176,734	169,253
									うち無担	132,874	133,331	139,120	146,126	139,529
									うちO/N	65,991	63,298	67,327	71,208	65,936
									うち有担	30,297	30,726	30,525	30,608	29,724

●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非債務競争入札(億円)	非競争入札(億円)
流動性供給	363	-	5,000	2022/8/24	-	18,099.0	4,987.0	-	▲ 0.0020%	57.3502%	-	▲ 0.0030%	-	-
交付税特会	-	-	12,000	2022/8/31	2023/2/28	362,599.0	11,990.18	-	0.0000%	3.3068%	-	0.0000%	-	10.00

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/8/24			6,537	1,000	0.026		0.026	93.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/8/23	2022/8/24	▲ 0.350	9,020	9,020		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/23	2022/8/24	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/8/25	2022/9/1	2.580	2	2				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/8/24		0.030	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		2022/8/24		0.130	0	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。

●2022年8月24日の予定

*7月の米耐久財新規受注

◆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