

Central Daily Market Report

2022年8月29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29日 需給速報	2022年8月30日 需給予想	2022年8月31日 当社予想
銀行券	300	▲ 100	1,500
財政	▲ 2,900	▲ 1,200	▲ 2,500
資金過不足	▲ 2,600	▲ 1,300	▲ 1,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 5,000
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入	▲ 200	▲ 700	4,000
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援 社債等買入	▲ 100	▲ 100	
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			▲ 205,000
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 6,100	6,200	6,100
※ドル資金供給用担保提供増額			
当預増減	▲ 2,800	4,000	▲ 207,000
当座預金残高	5,388,900	5,392,900	5,185,900
準備預金残高	4,714,200		
積み終了先	4,713,700	8月30日以降の残り所要積立額	積数 1,700
超過準備	4,713,700	積数	1日平均 100
非準備預金先	674,700		
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 99.96%	日数	45.16%

●2022年8月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、邦銀・証券業態を中心に▲0.05~▲0.03%近辺の出合いで始まった。3日積み要因が剥落したものの、レート水準に大きな変化は見られず、前営業日比で概ね横ばい圏での推移となった。また、一巡後も同水準で散発的な出合いが見られた。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%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>

29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発行市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が行われ、大型発行も複数散見された。発行レートに大きな変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/8/29	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	
	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.093	0.240	0.025	27,878.96	▲ 762.42	138.16-18	138.69-71
T/N	▲ 0.045	▲ 0.026	▲ 0.041				-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.040	▲ 0.055				-	▲ 0.105						
2W			▲ 0.060				-	▲ 0.110						
3W							-	▲ 0.116						
1M							-	▲ 0.124						
3M			0.023				▲ 0.115	▲ 0.128						
6M							▲ 0.210	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144						
									日付	8/22	8/23	8/24	8/25	8/26
									日銀当預残	5,353,300	5,348,000	5,342,600	5,396,000	5,391,700
									準備預金残	4,672,100	4,666,600	4,672,800	4,716,200	4,715,700
									マネタリーベース	6,605,500	6,600,200	6,594,800	6,649,300	6,645,200
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.022%	▲0.031%	▲0.038%	▲0.039%
									コール市場残高	169,253	168,683	170,703	170,056	172,398
									うち無担	139,529	138,874	140,177	139,909	144,044
									うちO/N	65,936	63,721	64,084	62,671	65,026
									うち有担	29,724	29,809	30,526	30,147	28,354

●入札結果

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)		2022/8/29	2022/8/30	▲ 0.350	5,975	5,975		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/29	2022/8/30	▲ 0.350	41	41		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/8/30		0.035	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		2022/8/30		0.120	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。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特別第37期(借り換え)	2022/9/2		2,034	19
成長基盤強化	米ドル特別第33期(借り換え)	2022/9/2		3,530	24
成長基盤強化	米ドル特別第29期(借り換え)	2022/9/2		537	9

●2022年8月30日の予定

*7月の完全失業率 (市場予想: 2.6%)	*6月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札 (28,000億円、9/1発行)
*7月の有効求人倍率 (市場予想: 1.27倍)	*8月の米CB消費者信頼感指数	*交付税特別会計借入 (11,450億円、9/9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