

Central Daily Market Report

2022年8月24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24日 需給速報		2022年8月25日 需給予想		2022年8月26日 当社予想	
銀行券	100		▲ 1,100		▲ 1,000	
財政	▲ 8,100		40,900		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 8,000		39,800		▲ 6,000	
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			14,700			
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 社債等買入				▲ 100		
新型コロナウイルス感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 7,400	9,100		7,400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 5,400		61,700		▲ 6,000	
当座預金残高	5,342,600		5,404,300		5,398,300	
準備預金残高	4,672,800					
積み終了先	4,671,000		8月25日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,670,900		積数		4,400	
非準備預金先	669,800		1日平均		200	
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	99.89%	日数	29.03%		

●2022年8月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢より▲0.05~▲0.015%の出会いで始まった。引き続き調達水準を引き下げる動きが見られ、レートは低下した。一巡後はビッドが少ない中、▲0.06~▲0.04%台の出会いが散見された。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、▲0.10~▲0.09%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>

24日のアウトライト市場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

2022/8/24	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.031				-	▲ 0.093	0.220	0.005	28,313.47	▲ 139.28	136.76-78	136.54-55
T/N			▲ 0.023				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.020	▲ 0.034				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.027				-	▲ 0.108						
3W	▲ 0.035	▲ 0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.114						
1M							-	▲ 0.122						
3M							▲ 0.130	▲ 0.129						
6M							▲ 0.190	▲ 0.146						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.143						
									日付	8/17	8/18	8/19	8/22	8/23
									日銀当預残	5,357,300	5,362,500	5,356,300	5,353,300	5,348,000
									準備預金残	4,675,300	4,681,900	4,669,000	4,672,100	4,666,600
									マネタリーベース	6,609,600	6,615,500	6,609,100	6,605,500	6,600,200
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.014%	▲0.022%
									コール市場残高	164,057	169,645	176,734	169,253	168,683
									うち無担	133,331	139,120	146,126	139,529	138,874
									うちO/N	63,298	67,327	71,208	65,936	63,721
									うち有担	30,726	30,525	30,608	29,724	29,809

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/8/25			9,176	4,756	▲0.005		▲0.003	64.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/8/25			11,501	4,754	0.005		0.007	2.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/8/25			10,558	5,011	0.004		0.006	86.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/8/24	2022/8/25	▲ 0.350	7,341	7,341		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/24	2022/8/25	▲ 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		2022/8/25		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		2022/8/25		0.135	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25日の予定

*福岡県金融経済懇談会において中村審議委員講演
*月例経済報告
*7月の企業向けサービス価格指数

*ジャクソンホール会議(27日まで)
*4-6月期の米GDP改定値

*流動性供給
(5,000億円、8/26発行)
*交付税借入
(12,000億円、9/2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