

Central Daily Market Report

2022年8月31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31日 需給速報		2022年9月1日 需給予想		2022年9月2日 当社予想	
銀行券	0		▲ 200		500	
財政	▲ 6,100		▲ 40,800		▲ 50,500	
資金過不足	▲ 6,100		▲ 41,000		▲ 50,000	
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	13,700	▲ 5,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			12,400			
CP等買入	4,000	▲ 2,400		▲ 300		
貸出支援基金(成)						▲ 2,900
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 400				
新型コロナウイルス対応金融支援特別	11,700	▲ 205,000				
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 6,000	7,900		6,000		
*ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 186,600		▲ 22,900		▲ 52,900	
当座預金残高	5,196,600		5,173,700		5,120,800	
準備預金残高	4,542,500					
積み終了先	4,542,100		9月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,542,100		積数		800	
非準備預金先	654,100		1日平均		100	
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		99.98%		日数	
					51.61%	

●2022年8月31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▲0.05~▲0.03%の出会いで始まった。月末要因により、ビッド数がやや減少した事から、調達に慎重となる先も複数見られた。一巡後は▲0.05~▲0.04%近辺で散発的な出会いが見られた。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~▲0.085%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>

31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、大口案件も見られたが、発行件数が少なく閑散とした出会いに終始した。

●短期金融市場関連指標

2022/8/31	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.094	0.220	0.000	28,091.53	▲ 104.05	138.76-78	138.58-61
T/N	▲ 0.045	▲ 0.027	▲ 0.038				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.025	▲ 0.041				-	▲ 0.107						
2W	▲ 0.038	▲ 0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.113						
3W							-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.055	▲ 0.012	▲ 0.031				-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.118	▲ 0.128						
6M							▲ 0.210	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144						
									日付	8/24	8/25	8/26	8/29	8/30
									日銀当預残	5,342,600	5,396,000	5,391,700	5,388,900	5,383,200
									準備預金残	4,672,800	4,716,200	4,715,700	4,714,200	4,706,600
									マネタリーベース	6,594,800	6,649,300	6,645,200	6,642,100	6,636,500
									無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.038%	▲0.039%	▲0.039%	▲0.039%
									コール市場残高	170,703	170,056	172,398	172,977	173,082
									うち無担	140,177	139,909	144,044	144,259	144,505
									うちO/N	64,084	62,671	65,026	66,031	66,517
									うち有担	30,526	30,147	28,354	28,718	28,577

●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	募入最高利率	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	第1非価格競争入札(億円)
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3年超5年以下)	4,750	2022/9/1			13,513	4,753	0.001		0.002	38.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/9/1			9,309	5,006	0.000		0.002	59.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/9/1			6,684	1,256	▲0.002		0.000	19.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/9/1			2,025	502	▲0.002		▲0.001	55.0
国債買入(物価連動債)	600	2022/9/1			2,209	601	▲0.200		▲0.378	47.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/8/31	2022/9/1	▲0.350	5,897	5,897		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/31	2022/9/1	▲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		2022/9/1		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		2022/9/1		0.110	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9月1日の予定

*4-6月期の法人企業統計調査季報	*7月の米建設支出 *8月のISM 製造業景況指数	*10年利付国債入札 (27,000億円、9/2発行)
-------------------	------------------------------	--------------------------------

◆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