Central Daily Market Report

2022年8月1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1日 需給速報	2022年8月2日 需給予想	2022年8月3日 当社予想
銀行券	400	100	1,000
財政	▲ 19,100	▲ 17,400	▲ 78,000
資金過不足	▲ 18,700	▲ 17,300	▲ 77,000

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						▲ 2,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,000					
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				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 7,000	9,800		7,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 5,000		▲ 10,500		▲ 79,300	

当座預金残高	5,402,100	5,391,600	5,312,300
準備預金残高	4,718,800		
積み終了先	4,718,800	8月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,718,600	積数	300
非準備預金先	683,300	1日平均	0
積み期間（7/16～8/15）の所要準備額			3,870,200
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数 54.84%

●2022年8月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、8月に入り積み後半となったが、参加者の姿勢に大きな変化はなく、引き続きレート水準は高止まりしている。朝方は、邦銀業態を中心に▲0.010～▲0.008%近辺での出合いが見られた。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、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.14～▲0.10%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>

本日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2022/8/1	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.040	0.001	▲ 0.010				－	▲ 0.099
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				－	▲ 0.111
S/N							－	－
1W	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.009				－	▲ 0.136
2W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.020				－	▲ 0.141
3W							－	▲ 0.144
1M	▲ 0.040	0.000	▲ 0.019				－	▲ 0.149
3M							▲ 0.142	▲ 0.148
6M							▲ 0.215	▲ 0.149
1Y							▲ 0.140	▲ 0.145

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.180	0.005	27,993.35	191.71	133.36-37	132.55-56

日付	7/25	7/26	7/27	7/28	7/29
日銀当預残	5,506,500	5,524,500	5,514,700	5,512,500	5,407,100
準備預金残	4,824,500	4,852,600	4,842,500	4,828,700	4,728,200
マネタリーベース	6,756,900	6,775,400	6,765,900	6,765,000	6,659,700
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%
コール市場残高	185,094	187,414	188,649	187,640	189,091
うち無担	155,796	158,051	159,401	158,529	161,095
うちO/N	81,228	83,103	83,318	82,181	86,977
うち有担	29,298	29,363	29,248	29,111	27,996

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/8/1	2022/8/2	▲ 0.350	6,909	6,909		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/8/1	2022/8/2	▲ 0.350	2	2		▲0.500	▲0.500	
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/8/2		0.075	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		2022/8/2		0.210	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2日の予定

*7月のマネタリーベース
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
*10年利付国債入札
（27,000億円、8/3発行）

◆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。
◆本資料は何ら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論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