

# Central Daily Market Report

2022年8月2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2日 需給速報	2022年8月3日 需給予想	2022年8月4日 当社予想
銀行券	100	400	500
財政	▲ 15,200	▲ 80,100	1,000
資金過不足	▲ 15,100	▲ 79,700	1,500
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,100	▲ 2,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		1,000	
国債買入			▲ 100
CP等買入			
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	▲ 200
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	▲ 7,600	7,000	7,600
米ドル資金供給(国債担保供給)			
当増減	▲ 15,900	▲ 71,600	1,500
当座預金残高	5,386,200	5,314,600	5,316,100
準備預金残高	4,702,900		
積み終了先	4,702,900		8月3日以降の残り所要積立額
超過準備	4,702,900		積数
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
			58.06%

## ●2022年8月2日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、レート水準は高止まりとなった。朝方は、▲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、ショートタームの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.13~▲0.085%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>

2日のアウトライ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発行市場は案件に乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2022/8/2	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.103	0.170	▲ 0.010	27,594.73	▲ 398.62	131.39-40	130.82-84
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.127						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.009	▲ 0.027				-	▲ 0.137						
2W	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.016				-	▲ 0.141						
3W							-	▲ 0.145						
1M			▲ 0.015				-	▲ 0.148						
3M							▲ 0.142	▲ 0.149						
6M							▲ 0.215	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.140	▲ 0.142						
									日付	7/26	7/27	7/28	7/29	8/1
									日銀当預残	5,524,500	5,514,700	5,512,500	5,407,100	5,402,100
									準備預金残	4,852,600	4,842,500	4,828,700	4,728,200	4,718,800
									マネタリーベース	6,775,400	6,765,900	6,765,000	6,659,700	6,654,300
									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	187,414	188,649	187,640	189,091	175,183
									うち無担	158,051	159,401	158,529	161,095	149,121
									うちO/N	83,103	83,318	82,181	86,977	79,033
									うち有担	29,363	29,248	29,111	27,996	26,062

## ●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非面格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	367	0.200%	27,000	2022/8/3	2032/6/20	66,012.0	21,885.00	100.2500	0.1740%	73.0170%	100.3100	0.1680%	5,108.0	2.85

## ●オペ結果

種類	オフア額(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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2022/8/3	2022/8/17		2,051	2,051				
国庫短期証券買入	1,000	2022/8/3			6,637	1,000		0.016	0.016	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/8/2	2022/8/3	▲ 0.350	7,481	7,481		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/8/2	2022/8/3	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/8/4	2022/8/12	2.580	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		2022/8/3		0.070	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		2022/8/3		0.205	0	0				

\*オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)の場合は、上取期間利回り。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ア。※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ア。

## ●2022年8月3日の予定

*8月の日銀当座預金増減要因見込み	*6月の米製造業新規受注・出荷・在庫 *7月のISM 非製造業景況指数
-------------------	--

◆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