

# Central Daily Market Report

2022年8月4日(木)  
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4日 需給速報	2022年8月5日 需給予想	2022年8月8日 当社予想
銀行券	▲ 500	0	1,000
財政	400	8,100	3,000
<b>資金過不足</b>	<b>▲ 100</b>	<b>8,100</b>	<b>4,000</b>

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						
国庫短期証券入						
国債買入	12,400					
CP等買入				▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
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	▲ 6,200	6,600		6,200		
※ドル資産増減(前日比)						
<b>当増増減</b>	<b>12,700</b>		<b>14,100</b>		<b>4,000</b>	

当座預金残高	5,321,100	5,335,200	5,339,200
準備預金残高	4,658,000		
積み終了先	4,658,000		
超過準備	4,657,900		
非準備預金先	663,100		
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
			64.52%

## ●短期金融市場関連指標

2022/8/4 単位：%	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
	最低	最高	平均	最低	最高	平均		
O/N	▲ 0.040	0.001	▲ 0.009				-	▲ 0.095
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.100
S/N							-	-
1W	▲ 0.018	▲ 0.009	▲ 0.010				-	▲ 0.119
2W	▲ 0.020	0.160	▲ 0.012				-	▲ 0.127
3W							-	▲ 0.133
1M			0.200				-	▲ 0.139
3M			0.030				▲ 0.142	▲ 0.144
6M							▲ 0.215	▲ 0.150
1Y							▲ 0.145	▲ 0.141

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)
0.170	▲ 0.015	27,932.20		190.30		133.92-95	134.15-16
日付		7/28	7/29	8/1	8/2	8/3	
日銀当預残		5,512,500	5,407,100	5,402,100	5,386,200	5,308,400	
準備預金残		4,828,700	4,728,200	4,718,800	4,702,900	4,632,400	
マネタリーベース		6,765,000	6,659,700	6,654,300	6,638,300	6,560,100	
無担O/N加重平均		▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.009%	
コール市場残高		187,640	189,091	175,183	192,248	189,548	
うち無担		158,529	161,095	149,121	165,153	159,980	
うちO/N		82,181	86,977	79,033	90,885	83,847	
うち有担		29,111	27,996	26,062	27,095	29,568	

## ●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
物価連動10年	27	0.005%	2,500	2022/8/5	2032/3/10	8,307.0	2,500.00	107.3500	▲ 0.7080%	54.0000%			

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/8/4	2022/8/5	▲ 0.350	6,066	6,058		▲ 0.350	▲ 0.357	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/4	2022/8/5	▲ 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		2022/8/5		0.065	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		2022/8/5		0.206	0	0				

\*オペの種類が、国債補充供給(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5日の予定

*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*7月の米雇用統計	*国庫短期証券(1099回)入札 (3ヶ月、56,000億円、8/8発行)
*6月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比+1.5%)	*6月の米消費者信用残高	*交付税特別会計借入 (12,000億円、8/19借入)
*6月の毎月勤労統計調査速報		
*6月の景気動向指数速報		

◆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。  
◆本資料は向から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