

# Central Daily Market Report

2022年8月8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8日 需給速報		2022年8月9日 需給予想		2022年8月10日 当社予想	
銀行券	100		▲ 100		▲ 1,000	
財政	4,200		▲ 3,700		▲ 22,000	
資金過不足	4,300		▲ 3,800		▲ 23,000	
<b>金融調節</b>	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						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
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						
国債補完供給	▲ 9,900	11,300		9,900		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	5,500		6,000		▲ 23,000	
当座預金残高	5,326,700		5,332,700		5,309,700	
準備預金残高	4,677,800					
積み終了先	4,677,800		8月9日以降の残り所要積立額		積数 100	
超過準備	4,677,800		積数		1日平均 0	
非準備預金先	648,900					
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額					3,873,200	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	77.42%		

## ●2022年8月8日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、参加者の動向に特段の変化はなく、前営業日と比べ概ね横這い圏での取引となった。朝方は、邦銀の調達を中心に▲0.010~▲0.008%近辺が出合いの中心となった。一巡後も同水準で散発的に出合いが見られた。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見されたものの、16日からの新積み期を控え様子見姿勢の先が多く、動意に乏しい展開となった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.08%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>

8日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートは横ばい圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/8/8	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				-	▲ 0.089	0.170	0.010	28,249.24	73.37	135.06-08	134.98-00
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.088						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.030	▲ 0.034				-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.015	▲ 0.008	▲ 0.012				-	▲ 0.115						
3W							-	▲ 0.122						
1M							-	▲ 0.130						
3M							▲ 0.120	▲ 0.134						
6M							▲ 0.215	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.145	▲ 0.141						
									日付	8/1	8/2	8/3	8/4	8/5
									日銀当預残	5,402,100	5,386,200	5,308,400	5,321,100	5,321,200
									準備預金残	4,718,800	4,702,900	4,632,400	4,658,000	4,660,100
									マネタリーベース	6,654,300	6,638,300	6,560,100	6,573,200	6,573,300
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%
									コール市場残高	175,183	192,248	189,548	187,393	190,113
									うち無担	149,121	165,153	159,980	158,235	160,814
									うちO/N	79,033	90,885	83,847	82,442	83,971
									うち有担	26,062	27,095	29,568	29,158	29,299

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/8/8	2022/8/9	▲ 0.350	9,739	9,739		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/8	2022/8/9	▲ 0.350	20	20		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/8/9		0.090	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		2022/8/9		0.225	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9日の予定

*7月のマネーストック	*国庫短期証券(1100回)入札 (6ヶ月、40,000億円、8/10発行)
*6月の特定サービス産業動態統計速報	*30年利付国債入札 (9,000億円、8/10発行)
	*エネルギー対策借入 (6,700億円、8/22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