

# Central Daily Market Report

2022年8月10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10日 需給速報		2022年8月12日 需給予想		2022年8月15日 当社予想	
銀行券	▲ 700		▲ 400		1,000	
財政	▲ 23,400		▲ 900		69,000	
資金過不足	▲ 24,100		▲ 1,300		70,000	
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			14,600			
CP等買入		▲ 800		▲ 500	4,000	
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	▲ 9,300	10,500		9,300		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 23,700		22,100		74,000	
当座預金残高	5,297,700		5,319,800		5,393,800	
準備預金残高	4,662,700					
積み終了先	4,662,700		8月12日以降の残り所要積立額		積数	
超過準備	4,662,700				0	
非準備預金先	635,000				1日平均	
					0	
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	87.10%		

## ●2022年8月10日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、祝日を前に2日積みの取引となった事で、調達レートを若干引き上げる先が散見された。朝方は、邦銀の調達を中心に▲0.009~▲0.006%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、新しい積み期となる16日スタートの案件を中心に引き合いが散見された。

### <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>

10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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/8/10	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.035	0.001	▲ 0.008					-	▲ 0.086	0.190	0.030	27,819.33	▲ 180.63	135.19-20	134.94-96
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.087						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.009					-	▲ 0.099						
2W			▲ 0.010					-	▲ 0.108						
3W								-	▲ 0.118						
1M								-	▲ 0.125						
3M			0.000					▲ 0.115	▲ 0.129						
6M								▲ 0.170	▲ 0.148						
1Y								▲ 0.145	▲ 0.141						
										日付	8/3	8/4	8/5	8/8	8/9
										日銀当預残	5,308,400	5,321,100	5,321,200	5,326,700	5,321,400
										準備預金残	4,632,400	4,658,000	4,660,100	4,677,800	4,685,900
										マネタリーベース	6,560,100	6,573,200	6,573,300	6,578,600	6,573,500
										無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.009%
										コール市場残高	189,548	187,393	190,113	183,792	176,295
										うち無担	159,980	158,235	160,814	154,958	147,153
										うちO/N	83,847	82,442	83,971	77,815	70,210
										うち有担	29,568	29,158	29,299	28,834	29,142

## ●入札結果

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)	投分レート ・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	投分 比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/8/12			8,550	4,752	▲0.002		0.000	39.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/8/12			14,899	4,753	0.000		0.004	21.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/8/12			14,873	5,006	0.001		0.006	16.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/8/10	2022/8/12	▲ 0.350	9,177	9,177		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/10	2022/8/12	▲ 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		2022/8/12		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		2022/8/12		0.220	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11日の予定

\*山の日

\*7月の米生産者物価指数

## ●2022年8月12日の予定

\*8月のミシガン大消費者信頼感指数速報

\*4-6月期の英GDP速報値

\*国庫短期証券(1101回)入札

(3ヶ月、56,000億円、8/15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