

# Central Daily Market Report

2022年8月25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25日 需給速報	2022年8月26日 需給予想	2022年8月29日 当社予想			
銀行券	▲ 1,100	▲ 300	▲ 1,000			
財政	39,800	▲ 4,200	2,000			
資金過不足	38,700	▲ 4,500	1,000			
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	14,700					
CP等買入		▲ 100		▲ 900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 100				
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	▲ 7,200	7,400		7,200		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	53,400	1,800		1,000		
当座預金残高	5,396,000	5,397,800		5,398,800		
準備預金残高	4,716,200					
積み終了先	4,715,700			8月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,715,400			積数	3,600	
非準備預金先	679,800			1日平均	200	
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額					3,873,500	
準備預金進捗率	実績	99.91%	日数	32.26%		

## ●2022年8月25日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.05~▲0.02%の出会いで始まった。引き続きビッドサイドに慎重な姿勢が見られ、レート水準は前日比で低下となった。一巡後は▲0.05%近辺で出会いが散見された。ターム物は、目立った出会いが見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%程度での出会い。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>

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、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

2022/8/25	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.094	0.225	0.005	28,479.01	165.54	137.09-11	136.47-50
T/N	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.029				-	▲ 0.101						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.027	▲ 0.013	▲ 0.020				-	▲ 0.107						
2W			▲ 0.025				-	▲ 0.112						
3W							-	▲ 0.117						
1M			0.001				-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.130	▲ 0.130						
6M							▲ 0.190	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144						
									日付	8/18	8/19	8/22	8/23	8/24
									日銀当預残	5,362,500	5,356,300	5,353,300	5,348,000	5,342,600
									準備預金残	4,681,900	4,669,000	4,672,100	4,666,600	4,672,800
									マネタリーベース	6,615,500	6,609,100	6,605,500	6,600,200	6,594,800
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.009%	▲0.014%	▲0.022%	▲0.031%
									コール市場残高	169,645	176,734	169,253	168,683	170,703
									うち無担	139,120	146,126	139,529	138,874	140,177
									うちO/N	67,327	71,208	65,936	63,721	64,084
									うち有担	30,525	30,608	29,724	29,809	30,526

## ●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I非償 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億円)
流動性供給	364	-	5,000	2022/8/26	-	11,994.0	4,992.0	-	0.0340%	46.2311%	-	0.0290%	-	-
交付税特会	-	-	12,000	2022/9/2	2023/3/6	369,106.0	11,990.33	-	0.0000%	3.2485%	-	0.0000%	-	10.00

## ●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)		2022/8/25	2022/8/26	▲ 0.350	7,133	7,133		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/25	2022/8/26	▲ 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		2022/8/26		0.030	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		2022/8/26		0.125	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26日の予定

*8月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想：前年同月比(除く生鮮)+2.5%)	*7月の米個人所得・消費支出	*国庫短期証券(1104回)入札 (3ヶ月、56,000億円、8/29発行)
--	----------------	---

◆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