Central Daily Market Report

2022年8月30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30日 需給速報		2022年8月31日 需給予想		2022年9月1日 当社予想	
銀行券	▲ 100		0		500	
財政	▲ 3,000		▲ 5,000		▲ 29,500	
資金過不足	▲ 3,100		▲ 5,000		▲ 29,000	
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			13,700	▲ 5,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 700	4,000	▲ 2,400		
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		▲ 400		
新型コロナ対応金融支援特別			11,700	▲ 205,000		
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 7,900	6,100		7,900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 5,700		▲ 179,500		▲ 29,000	
当座預金残高	5,383,200		5,203,700		5,174,700	
準備預金残高	4,706,600					
積み終了先	4,706,200		8月31日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,706,200		積数	1,300		
非準備預金先	676,600		1日平均	100		
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	99.97%	日数	48.39%		

●2022年8月30日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、国内勢を中心に▲0.05～▲0.03%近辺の出合いで始まった。参加者の動向に大きな変化は見られず、レート水準は概ね横這い圏での推移となった。一巡後は、レート水準がやや低下し▲0.06～▲0.045%近辺で出合いが散見された。ターム物は、1～2W物で引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105～▲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>

30日のアウトライト市場では動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。また、短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされた。按分利回り較差、平均利回り較差ともに前回比でやや低下したものの、引き続き甘めの結果となった。

<CP市場>

CP発行市場は、月初発行にあたり、複数の業態から発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●2022年8月31日の予定

*函館市金融経済懇談会において中川審議委員講演
*7月の商業動態統計速報
*7月の鉱工業生産・出荷・在庫速報（市場予想：前月比▲0.5%）
*7月の住宅着工統計 *8月の消費動向調査
*8月のシカゴPM景況感指数 *8月のユーロ圏消費者物価指数速報値

●短期金融市場関連指標

2022/8/30	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.039				－	▲ 0.096
T/N			▲ 0.026				－	▲ 0.105
S/N							－	－
1W	▲ 0.065	▲ 0.020	▲ 0.039				－	▲ 0.111
2W	▲ 0.060	▲ 0.015	▲ 0.028				－	▲ 0.113
3W							－	▲ 0.117
1M			0.000				－	▲ 0.128
3M							▲ 0.118	▲ 0.128
6M							▲ 0.210	▲ 0.147
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144

JGB新発10年債	
直近値	前日比
0.220	▲ 0.020

日経平均株価	
15時時点	前日比
28,195.58	316.62

ドル/円	
為替（9時）	為替（17時）
138.64-66	138.45-47

日付	8/23	8/24	8/25	8/26	8/29
日銀当預残	5,348,000	5,342,600	5,396,000	5,391,700	5,388,900
準備預金残	4,666,600	4,672,800	4,716,200	4,715,700	4,714,200
マネタリーベース	6,600,200	6,594,800	6,649,300	6,645,200	6,642,100
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.031%	▲0.038%	▲0.039%	▲0.039%
コール市場残高	168,683	170,703	170,056	172,398	172,977
うち無担	138,874	140,177	139,909	144,044	144,259
うちO/N	63,721	64,084	62,671	65,026	66,031
うち有担	29,809	30,526	30,147	28,354	28,718

●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非価格競争入札（億円）	非競争入札（億円）
2年利付国債	440	0.005%	28,000	2022/9/1	2024/9/1	82,003.0	22,703.00	100.1700	▲0.0790%	0.4242%	100.1770	▲0.0830%	5,290.0	
交付税特会	－	－	11,450	2022/9/9	2023/3/10	363,320.0	11,430.13	－	0.0000%	3.1461%	－	0.0000%	－	20.00

●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
共通担保資金供給（全店）＜固定金利方式＞	20,000	2022/8/31	2022/9/14		13,651	13,651				
国庫短期証券買入	1,000	2022/8/31			4,468	1,000	0.021		0.022	90.1
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/8/30	2022/8/31	▲ 0.350	7,746	7,746		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/8/30	2022/8/31	▲ 0.350	99	99		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2022/9/1	2022/9/8	2.590	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		2022/8/31		0.010	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		2022/8/31		0.080	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。

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
新型コロナ対応金融支援特別	制度融資分	2022/8/31	2023/2/28	0	7,217
新型コロナ対応金融支援特別	プロパー融資分	2022/8/31	2023/2/28	0	4,496

（参考）2022/8/31時点の貸出残高（億円）	
制度融資分(2022/4/1以降実行)	26,486
プロパー融資分(2022/4/1以降実行)	8,500
2022/3/31以前に実行された貸付け	287,713
合計	322,699

◆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論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