

●資金需給

単位：億円	2022年9月7日 需給速報	2022年9月8日 需給予想	2022年9月9日 当社予想
銀行券	500	▲ 100	500
財政	▲ 11,700	▲ 5,600	▲ 6,500
資金過不足	▲ 11,200	▲ 5,700	▲ 6,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入	1,000		
国債買入		16,500	
CP等買入		▲ 200	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)		▲ 23,600	
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	▲ 6,800	7,500	6,800
米ドル資金供給用国債補完供給			
当預増減	▲ 9,500	▲ 6,200	▲ 6,000
当座預金残高	5,122,200	5,116,000	5,110,000
準備預金残高	4,502,400		
積み終了先	4,502,300		9月8日以降の残り所要積立額
超過準備	4,502,300		積数
非準備預金先	619,800		1日平均
積み期間(8/16~9/15)の所要準備額			3,872,100
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			74.19%

●短期金融市場関連指標

2022/9/7	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	▲ 0.073	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.089
T/N			▲ 0.044				-	▲ 0.086
S/N							-	-
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.093
2W	▲ 0.055	▲ 0.040	▲ 0.052				-	▲ 0.104
3W							-	▲ 0.112
1M							-	▲ 0.134
3M			0.025				▲ 0.118	▲ 0.129
6M							▲ 0.210	▲ 0.147
1Y							▲ 0.165	▲ 0.146

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)
0.245	0.010	27,430.30	▲ 196.21	143.15-17	143.89-91

日付	8/31	9/1	9/2	9/5	9/6
日銀当預残	5,196,600	5,169,300	5,117,700	5,117,500	5,131,700
準備預金残	4,542,500	4,511,900	4,464,000	4,475,000	4,498,400
マネタリーベース	6,449,900	6,422,800	6,371,000	6,370,100	6,383,400
無担O/N加重平均	▲ 0.041%	▲ 0.044%	▲ 0.048%	▲ 0.047%	▲ 0.043%
コール市場残高	164,137	179,867	185,900	173,542	175,899
うち無担	136,535	150,689	156,100	142,847	144,434
うちO/N	65,692	68,076	66,717	58,114	60,016
うち有担	27,602	29,178	29,800	30,695	31,465

●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)	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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2022/9/8			4,518	1,501	0.008		0.013	11.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/9/8			14,763	4,752	0.002		0.004	41.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/9/8			7,902	4,752	0.005		0.011	67.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,500	2022/9/8			10,745	5,505	0.016		0.020	91.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/9/7	2022/9/8	▲ 0.350	6,754	6,754		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/9/7	2022/9/8	▲ 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		2022/9/8		0.015	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		2022/9/8		0.095	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2022/9/8		0.065	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  
※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。 ※3固定利回較差の結果、10年利付国債357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9月8日の予定

*4-6月期のGDP 2次速報 (市場予想：前期比年率+2.9%) *7月の国際収支 *8月の景気ウォッチャー調査	*ECB定例理事会(金融政策発表) *7月の米消費者信用残高	*国庫短期証券(1106回)入札 (6ヶ月、40,000億円、9/12発行) *流動性供給入札(5,000億円、9/9発行) *エネルギー対策借入 (5,500億円、9/20借入)
--	-----------------------------------	--

◆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