

# Central Daily Market Report

2022年8月9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9日 需給速報	2022年8月10日 需給予想	2022年8月12日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 700	▲ 500			
財政	▲ 4,400	▲ 23,500	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 4,600	▲ 24,200	▲ 7,500			
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						
CP等買入		▲ 100		▲ 800		
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	▲ 10,500	9,900		10,500		
米ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	▲ 5,300	▲ 14,500		▲ 7,500		
当座預金残高	5,321,400	5,306,900		5,299,400		
準備預金残高	4,685,800					
積み終了先	4,685,800			8月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,685,800			積数	100	
非準備預金先	635,600			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	80.65%		

## ●2022年8月9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、昨日と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~▲0.007%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、▲0.085~▲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>

9日はTB6M物(第1100回)の入札が実施され、テールが流れるやや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかりと推移した。このほか、3M物でも出合いが見られた。

### <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。発行レートに目立った変化は見られなかった。また、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート0.000%、平均レート+0.001%と前回(按分0.000%、平均+0.019%)比で、按分は横ばい、平均は低下した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/8/9	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.087	0.160	▲ 0.010	27,999.96	▲ 249.28	134.84-86	134.88-90
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.086						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.034					-	▲ 0.100						
2W	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.013					-	▲ 0.112						
3W								-	▲ 0.121						
1M								-	▲ 0.127						
3M			0.028					▲ 0.115	▲ 0.132						
6M								▲ 0.170	▲ 0.147						
1Y								▲ 0.145	▲ 0.140						
										日付	8/2	8/3	8/4	8/5	8/8
										日銀当預残	5,386,200	5,308,400	5,321,100	5,321,200	5,326,700
										準備預金残	4,702,900	4,632,400	4,658,000	4,660,100	4,677,800
										マネタリーベース	6,638,300	6,560,100	6,573,200	6,573,300	6,578,600
										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	192,248	189,548	187,393	190,113	183,792
										うち無担	165,153	159,980	158,235	160,814	154,958
										うちO/N	90,885	83,847	82,442	83,971	77,815
										うち有担	27,095	29,568	29,158	29,299	28,834

## ●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1100	-	40,000	2022/8/10	2023/2/10	128,720.0	32,548.7	100.0700	▲0.1387%	38.7829%	100.0890	▲0.1763%	7,451.0
30年利付国債	75	1.30%	9,000	2022/8/10	2052/6/20	21,396.0	7,247.0	103.8500	1.1270%	84.7290%	104.0400	1.1190%	1,747.0
エネルギー対策	-	-	6,700	2022/8/22	2023/8/21	153,575.0	6,699.88	-	0.0000%	4.5617%	-	0.0000%	-

## ●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)		2022/8/9	2022/8/10	▲ 0.350	10,380	10,380		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/9	2022/8/10	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/8/12	2022/8/18	2.600	0	0				
CP等買入	4,000	2022/8/15			12,375	3,972	0.000		0.001	16.1
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/8/10		0.080	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		2022/8/10		0.211	0	0				

\*オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)の場合は、上原期間利回り、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10日の予定

*7月の企業物価指数	*7月の米消費者物価指数
	*6月の米卸売売上高
	*7月の米財政収支

◆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