

# Central Daily Market Report

2022年8月26日(金)

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26日 需給速報		2022年8月29日 需給予想		2022年8月30日 当社予想	
銀行券	▲ 300		300		▲ 500	
財政	▲ 4,100		▲ 5,300		▲ 3,000	
資金過不足	▲ 4,400		▲ 5,000		▲ 3,500	
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		▲ 900		▲ 200		
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	▲ 6,200	7,200		6,200		
当預増減	▲ 4,300		900		▲ 3,500	
当座預金残高	5,391,700		5,392,600		5,389,100	
準備預金残高	4,715,700					
積み終了先	4,715,200		8月29日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,715,200		積数		2,200	
非準備預金先	676,000		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		99.94%		日数	
					41.94%	

## ●2022年8月26日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀・証券業態を中心に▲0.05~▲0.02%の出会いが始まった。週末3日積みとなったが、レート水準は概ね横這い圏での推移となった。一巡後は▲0.07~▲0.05%のレンジまで低下し、散発的に出会いが見られた。ターム物は、ロール案件の引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.085%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>

26日はTB3M物(第1104回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

### <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。CP等買入オペが4,000億円度でオファーされ、平均レートは+0.022%、按分レートは+0.001%と前回比で共に上昇となった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/8/26	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.093	0.215	▲ 0.010	28,641.38	162.37	136.56-58	137.01-04
T/N	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.038				-	▲ 0.097						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.025	0.005	▲ 0.019				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.040	▲ 0.002	▲ 0.031				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.118						
1M							-	▲ 0.125						
3M							▲ 0.113	▲ 0.129						
6M							▲ 0.210	▲ 0.147						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.144						
									日付	8/19	8/22	8/23	8/24	8/25
									日銀当預残	5,356,300	5,353,300	5,348,000	5,342,600	5,396,000
									準備預金残	4,669,000	4,672,100	4,666,600	4,672,800	4,716,200
									マネタリーベース	6,609,100	6,605,500	6,600,200	6,594,800	6,649,300
									無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.014%	▲0.022%	▲0.031%	▲0.038%
									コール市場残高	176,734	169,253	168,683	170,703	170,056
									うち無担	146,126	139,529	138,874	140,177	139,909
									うちO/N	71,208	65,936	63,721	64,084	62,671
									うち有担	30,608	29,724	29,809	30,526	30,147

## ●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	素分率	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	1104	-	56,000	2022/8/29	2022/11/28	133,825.0	45,669.60	100.0265	▲0.1062%	26.3366%	100.0283	▲0.1134%	10,330.0

## ●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)		2022/8/26	2022/8/29	▲ 0.350	6,148	6,148		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/8/26	2022/8/29	▲ 0.350	0	0				
CP等買入	4,000	2022/8/31			11,985	3,985	0.001		0.022	6.5
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/8/29		0.025	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		2022/8/29		0.110	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29日の予定

\*6月の景気動向指数改訂状況

\*London祝日(SummerBankHoliday)

◆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