Central Daily Market Report

2022年7月1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7月1日 需給速報	2022年7月4日 需給予想	2022年7月5日 当社予想
銀行券	▲ 200	600	1,000
財政	▲ 14,200	▲ 38,200	8,000
資金過不足	▲ 14,400	▲ 37,600	9,000

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						
CP等買入						
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						
ＥＴＦ買入			600			
国債補完供給	▲ 20,000	31,300		20,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 3,200		▲ 17,000		9,000	

当座預金残高	5,519,900	5,502,900	5,511,900
準備預金残高	4,848,900		
積み終了先	4,848,900		
超過準備	4,848,900		
非準備預金先	671,000		

7月4日以降の残り所要積立額	
積数	200
1日平均	0

積み期間（6/16～7/15）の所要準備額			3,743,800
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数 60.00%

●2022年7月1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▲0.04～▲0.015%の調達で始まった。調達ニーズが強いなか、週末3日積みであることも影響し、レート水準は前日比で上昇した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15～▲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>

1日はTB3M物（第1091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、しっかりと推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/7/1	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.026				－	▲ 0.114
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.150
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	0.005	▲ 0.035				－	▲ 0.144
2W	▲ 0.045	0.010	▲ 0.028				－	▲ 0.144
3W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.030				－	▲ 0.146
1M	▲ 0.045	0.200	▲ 0.015				－	▲ 0.146
3M							▲ 0.140	▲ 0.143
6M							▲ 0.135	▲ 0.132
1Y							▲ 0.125	▲ 0.129

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）
0.215	▲ 0.010	25,935.62	▲ 457.42	135.79-81	135.30-32

日付	6/24	6/27	6/28	6/29	6/30
日銀当預残	5,632,500	5,634,300	5,523,300	5,520,800	5,523,100
準備預金残	4,955,300	4,959,800	4,860,000	4,848,500	4,856,400
マネタリーベース	6,881,600	6,883,600	6,772,900	6,771,000	6,774,200
無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.040%	▲0.039%	▲0.033%	▲0.040%
コール市場残高	169,181	163,462	163,611	163,449	136,984
うち無担	140,165	134,522	133,677	135,062	111,871
うちO/N	61,877	56,464	55,739	58,287	72,196
うち有担	29,016	28,940	29,934	28,387	25,113

●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)
国庫短期証券	1091	－	56,000	2022/7/4	2022/10/3	153,195.0	45,289.80	100.0305	▲0.1222%	57.1428%	100.0334	▲0.1339%	10,710.0

●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）		2022/7/1	2022/7/4	▲0.350	19,652	19,652		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/1	2022/7/4	▲0.350	225	225		▲0.350	▲0.350	
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/7/4			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		2022/7/4			0	0				

※1国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）の固定利回較差は、0.001%。この結果、10年利付国債364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国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）の固定利回較差は、0.065%。この結果、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7月4日の予定

*6月のマネタリーベース
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み
*New York祝日（Independence Day）

◆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