Central Daily Market Report

2022年7月5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7月5日 需給速報	2022年7月6日 需給予想	2022年7月7日 当社予想
銀行券	▲ 200	400	▲ 1,000
財政	3,000	▲ 28,500	7,000
資金過不足	2,800	▲ 28,100	6,000

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			3,100	▲ 4,500		
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				▲ 100		
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	300					
国債補完供給	▲ 16,900	15,900		16,900		
米ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	2,000		▲ 11,700		6,000	

当座預金残高	5,488,200	5,476,500	5,482,500
準備預金残高	4,810,000		
積み終了先	4,810,000		
超過準備	4,810,000		
非準備預金先	678,200		

7月6日以降の残り所要積立額	
積数	100
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	100.00%	日数 66.67%

●2022年7月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O／N物は、邦銀を中心に▲0.02～▲0.01%の調達で始まった。調達ニーズは強く、一巡後も同水準での取引が続き本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームの出合いが散見される程度であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.18～▲0.105%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>

5日は短国買入オペが前回と同額の1000億円でオファーされ、弱め結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<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。

●短期金融市場関連指標

2022/7/5	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	▲ 0.050	0.001	▲ 0.016				－	▲ 0.147
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.153
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	▲ 0.012	▲ 0.016				－	▲ 0.159
2W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.024				－	▲ 0.159
3W			▲ 0.025				－	▲ 0.159
1M			▲ 0.047				－	▲ 0.161
3M			0.150				▲ 0.141	▲ 0.146
6M							▲ 0.135	▲ 0.135
1Y							▲ 0.129	▲ 0.130

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）
0.250	0.031	26,423.47	269.66	135.85-87	136.08-09

日付	6/28	6/29	6/30	7/1	7/4
日銀当預残	5,523,300	5,520,800	5,523,100	5,519,900	5,486,200
準備預金残	4,860,000	4,848,500	4,856,400	4,848,900	4,806,100
マネタリーベース	6,772,900	6,771,000	6,774,200	6,771,200	6,736,800
無担O/N加重平均	▲0.039%	▲0.033%	▲0.040%	▲0.026%	▲0.022%
コール市場残高	163,611	163,449	136,984	156,094	161,404
うち無担	133,677	135,062	111,871	130,510	131,525
うちO/N	55,739	58,287	72,196	68,925	64,370
うち有担	29,934	28,387	25,113	25,584	29,879

●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)
10年利付国債	367	0.200%	27,000	2022/7/6	2032/6/20	110,111.0	21,822.00	99.5100	**0.2500%**	**26.6152%**	99.5300	**0.2480%**	5,161.0	3.95

●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	2022/7/6	2022/7/20		3,051	3,051				
国庫短期証券買入	1,000	2022/7/6			4,994	1,000		0.020	0.020	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/7/5	2022/7/6	▲ 0.350	16,871	16,871		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/5	2022/7/6	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/7/7	2022/7/14	1.840	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		2022/7/6			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		2022/7/6			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、0.010%。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、0.085%。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6日の予定

*6月のISM 非製造業景況指数

*交付税特別会計借入
（13,000億円、7/20借入）

◆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