

# Central Daily Market Report

2022年7月7日(木)  
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7日 需給速報	2022年7月8日 需給予想	2022年7月11日 当社予想
銀行券	▲ 700	0	0
財政	1,200	2,600	9,000
資金過不足	500	2,600	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	12,500					
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						
新型コロナウイルス 感染症対策特別						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 14,000	16,700		14,000		
※ドル資金供給用国債提供						
当増増減	15,700		16,500		9,000	

当座預金残高	5,475,900	5,492,400	5,501,400	
準備預金残高	4,788,100			
積み終了先	4,788,100	7月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,788,100	積数	100	
非準備預金先	687,800	1日平均	0	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額			3,746,400	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	73.33%

## ●短期金融市場関連指標

2022/7/7 単位：%	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	▲ 0.045	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.104
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.153
S/N							-	-
1W			0.000				-	▲ 0.158
2W							-	▲ 0.160
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.160
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.162
3M							▲ 0.142	▲ 0.151
6M							▲ 0.190	▲ 0.137
1Y							▲ 0.130	▲ 0.134

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	0.000	26,490.53	382.88	135.94-95	136.11-14			
日付		6/30	7/1	7/4	7/5	7/6		
日銀当預残	5,523,100	5,519,900	5,486,200	5,488,200	5,460,200	5,460,200		
準備預金残	4,856,400	4,848,900	4,806,100	4,809,300	4,779,500	4,779,500		
マネタリーベース	6,774,200	6,771,200	6,736,800	6,739,100	6,710,700	6,710,700		
無担O/N加重平均	▲ 0.040%	▲ 0.026%	▲ 0.022%	▲ 0.016%	▲ 0.012%	▲ 0.012%		
コール市場残高	136,984	156,094	161,404	163,114	166,817	166,817		
うち無担	111,871	130,510	131,525	135,413	136,262	136,262		
うちO/N	72,196	68,925	64,370	67,018	67,164	67,164		
うち有担	25,113	25,584	29,879	27,701	30,555	30,555		

## ●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	棄分率	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	1092		24,000	2022/7/11	2023/1/10	100,425.0	19,415.7	100.0810	▲ 0.1614%	62.8920%	100.0850	▲ 0.1693%	4,584.0
30年利付国債	75	1.30%	9,000	2022/7/8	2052/6/20	23,467.0	7,231.00	101.3000	1.2400%	19.3059%	101.4300	1.2340%	1,758.0

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/7/7	2022/7/8	▲ 0.450	13,717	13,717		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/7/7	2022/7/8	▲ 0.450	163	163		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/7/8		0.005	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		2022/7/8		0.116	0	0				

\*オペの種類が、国債補充供給(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7月8日の予定

*5月の全世帯家計調査 (市場予想：消費支出、前年比+2.1%)	*5月の米卸売上高	*国庫短期証券(1093回)入札 (3ヶ月、56,000億円、7/11発行)
*5月の国際収支	*6月の米雇用統計	*エネルギー対策借入 (7,800億円、7/20借入)
*5月の特定サービス産業動態統計速報	*5月の米消費者信用残高	
*6月の景気ウォッチャー調査		

◆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