

Central Daily Market Report

2022年7月8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8日 需給速報	2022年7月11日 需給予想	2022年7月12日 当社予想
銀行券	100	800	1,000
財政	600	4,000	▲ 2,000
資金過不足	700	4,800	▲ 1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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	▲ 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対応金融支援特別			
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補充供給	▲ 13,400	13,900	13,400
※ドル資金供給用国債国債供給			
当増増減	1,100	18,100	▲ 1,000
当座預金残高	5,477,000	5,495,100	5,494,100
準備預金残高	4,793,500		
積み終了先	4,793,500		7月11日以降の残り所要積立額
超過準備	4,793,500		積数
非準備預金先	683,500		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
			83.33%

●2022年7月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.015~▲0.005%の調達で始まった。今積み期間、最後の週末3日積みとなった事で調達ニーズが強まり、前日対比でレートは上昇する展開となった。ターム物は、ショートタームの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲0.11%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>

8日はTB3M物(第1093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等買入オペが予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、平均落札レート0%、按分レートは▲0.001%となり、前日比(平均0.009%・按分▲0.001%)では、平均落札レートは低下、按分レートは横這いとなった。

●短期金融市場関連指標

2022/7/8	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.045	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.104	0.245	0.000	26.517.19	26.66	135.91-93	135.83-85	
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.129							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.027				-	▲ 0.152							
2W							-	▲ 0.155							
3W							-	▲ 0.157							
1M	▲ 0.030	0.100	0.035				-	▲ 0.161							
3M			0.000				▲ 0.148	▲ 0.151							
6M							▲ 0.190	▲ 0.137							
1Y							▲ 0.130	▲ 0.133							
									日付		7/1	7/4	7/5	7/6	7/7
									日銀当預残	5,519,900	5,486,200	5,488,200	5,460,200	5,475,900	
									準備預金残	4,848,900	4,806,100	4,809,300	4,779,500	4,788,100	
									マネタリーベース	6,771,200	6,736,800	6,739,100	6,710,700	6,727,000	
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.022%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.010%	
									コール市場残高	156,094	161,404	163,114	166,817	160,684	
									うち無担	130,510	131,525	135,413	136,262	131,087	
									うちO/N	68,925	64,370	67,018	67,164	60,889	
									うち有担	25,584	29,879	27,701	30,555	29,597	

●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	1093	-	56,000	2022/7/11	2022/10/11	128,868.0	45,289.4	100.0340	▲0.1348%	36.9235%	100.0358	▲0.1419%	10,710.0
エネルギー対策	-	-	7,800	2022/7/20	2023/7/20	206,619.0	7,799.81		0.0000%	3.9232%	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/7/8	2022/7/11	▲ 0.450	13,314	13,314		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/7/8	2022/7/11	▲ 0.450	0	0				
CP等買入	4,000	2022/7/13			10,965	3,981	▲ 0.001		0.000	18.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/7/11		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		2022/7/11		0.125	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11日の予定

*6月のマネーストック
*5月の機械受注統計
(市場予想：船舶・電力除く民需、前月比▲5.5%)

◆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