Central Daily Market Report

2022年7月11日（月）
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11日 需給速報	2022年7月12日 需給予想	2022年7月13日 当社予想
銀行券	800	200	▲ 500
財政	2,700	▲ 12,400	▲ 41,000
資金過不足	3,500	▲ 12,200	▲ 41,500

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		▲ 100			4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 14,500	13,400		14,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	2,300		2,100		▲ 37,500	

当座預金残高	5,479,300	5,481,400	5,443,900
準備預金残高	4,790,300		
積み終了先	4,790,300		
超過準備	4,790,300		
非準備預金先	689,000		

7月12日以降の残り所要積立額	
積数	0
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 86.67%

●2022年7月11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▲0.01～▲0.005%の調達で始まった。前営業日比では、横ばいから若干低下となったが、レート水準は引き続き高いところで推移している。ターム物は、ショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.200～▲0.140%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>

11日のアウトライト市場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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/7/11	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	▲ 0.045	0.001	▲ 0.010				－	▲ 0.146
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.163
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.013				－	▲ 0.161
2W			▲ 0.020				－	▲ 0.162
3W							－	▲ 0.159
1M			0.160				－	▲ 0.161
3M							▲ 0.150	▲ 0.150
6M							▲ 0.190	▲ 0.142
1Y							▲ 0.135	▲ 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）
0.240	▲ 0.005	26,812.30	295.11	136.30-32	136.80-82

日付	7/4	7/5	7/6	7/7	7/8
日銀当預残	5,486,200	5,488,200	5,460,200	5,475,900	5,477,000
準備預金残	4,806,100	4,809,300	4,779,500	4,788,100	4,793,500
マネタリーベース	6,736,800	6,739,100	6,710,700	6,727,000	6,728,000
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.016%	▲0.012%	▲0.010%	▲0.008%
コール市場残高	161,404	163,114	166,817	160,684	165,961
うち無担	131,525	135,413	136,262	131,087	135,988
うちO/N	64,370	67,018	67,164	60,889	66,390
うち有担	29,879	27,701	30,555	29,597	29,973

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ非価格競争入札（億円）
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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）		2022/7/11	2022/7/12	▲0.350	14,349	14,349		▲0.350	▲0.352	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/11	2022/7/12	▲0.350	89	89		▲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		2022/7/12		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		2022/7/12		0.105	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7月12日の予定

*6月の企業物価指数

*5年利付国債入札
（25,000億円、7/13発行）

◆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