Central Daily Market Report

2022年7月12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12日 需給速報	2022年7月13日 需給予想	2022年7月14日 当社予想
銀行券	100	0	▲ 1,000
財政	▲ 12,600	▲ 45,100	1,500
資金過不足	▲ 12,500	▲ 45,100	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			1,000			
国債買入						
CP等買入			4,000	▲ 300		
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	▲ 10,700	14,500		10,700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 8,900		▲ 29,700		500	

当座預金残高	5,470,400	5,440,700	5,441,200
準備預金残高	4,777,900		
積み終了先	4,777,900		
超過準備	4,777,900		
非準備預金先	692,500		

7月13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 90.00%

●2022年7月12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～▲0.004%の調達で始まった。今積み期間も残り僅かとなるなか、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、▲0.185～▲0.130%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>

12日は、短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、しっかりとした結果となった。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。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/7/12	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	▲ 0.008				－	▲ 0.119
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.159
S/N							－	－
1W	▲ 0.015	▲ 0.008	▲ 0.012				－	▲ 0.162
2W			▲ 0.003				－	▲ 0.159
3W							－	▲ 0.157
1M							－	▲ 0.160
3M	0.000	0.025	0.015				▲ 0.152	▲ 0.151
6M							▲ 0.190	▲ 0.141
1Y							▲ 0.140	▲ 0.135

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	0.000	26,336.66	▲ 475.64	137.41-42	137.34-35

日付	7/5	7/6	7/7	7/8	7/11
日銀当預残	5,488,200	5,460,200	5,475,900	5,477,000	5,479,300
準備預金残	4,809,300	4,779,500	4,788,100	4,793,500	4,790,300
マネタリーベース	6,739,100	6,710,700	6,727,000	6,728,000	6,729,500
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.012%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.010%
コール市場残高	163,114	166,817	160,684	165,961	163,012
うち無担	135,413	136,262	131,087	135,988	135,653
うちO/N	67,018	67,164	60,889	66,390	65,255
うち有担	27,701	30,555	29,597	29,973	27,359

●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)
5年利付国債	153	0.005%	25,000	2022/7/13	2027/6/20	79,165.0	20,210.0	99.8300	**0.0390%**	**97.0236%**	99.8300	**0.0390%**	4,784.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/7/13			6,741	1,000	0.000		0.000	39.2
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/7/12	2022/7/13	▲0.450	10,659	10,659		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/12	2022/7/13	▲0.450	0	0				
米ドル資金供給		2022/7/14	2022/7/21	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		2022/7/13		0.010	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		2022/7/13		0.085	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13日の予定

*米ベージュブック
*6月の米財政収支
*6月の米消費者物価指数
*交付税特別会計借入
（13,000億円、7/27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