

Central Daily Market Report

2022年7月13日(水)
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13日 需給速報	2022年7月14日 需給予想	2022年7月15日 当社予想			
銀行券	0	▲ 1,000	500			
財政	▲ 45,500	600	▲ 10,000			
資金過不足	▲ 45,500	▲ 400	▲ 9,500			
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			10,800			
CP等買入	4,000	▲ 300		▲ 400		
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	▲ 11,100	10,700		11,100		
※ドル資金需給速報(国債買入)						
当増減	▲ 41,200		21,100		▲ 9,500	
当座預金残高	5,429,200		5,450,300		5,440,800	
準備預金残高	4,746,600					
積み終了先 超過準備	4,746,600					
非準備預金先	682,600					
7月14日以降の残り所要積立額						0
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	93.33%		

●2022年7月13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~▲0.003%の調達で始まった。今積み期間も残り僅かとなり、最終調整の調達が見られている事もあり、レートは高止まりとなった。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>

13日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が実施された。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

2022/7/13 単位：%	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値	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	▲ 0.007						0.230	▲ 0.010	26.478.77	142.11	136.74-76	137.04-05
T/N			▲ 0.008											
S/N														
1W			▲ 0.028											
2W														
3W														
1M	▲ 0.040	0.160	0.033											
3M														
6M														
1Y														
日付		7/6	7/7	7/8	7/11	7/12								
日銀当預残		5,460,200	5,475,900	5,477,000	5,479,300	5,470,400								
準備預金残		4,779,500	4,788,100	4,793,500	4,790,300	4,777,900								
マネタリーベース		6,710,700	6,727,000	6,728,000	6,729,500	6,720,500								
無担O/N加重平均		▲0.012%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.010%	▲0.008%								
コール市場残高		166,817	160,684	165,961	163,012	167,439								
うち無担		136,262	131,087	135,988	135,653	139,428								
うちO/N		67,164	60,889	66,390	65,255	69,080								
うち有担		30,555	29,597	29,973	27,359	28,011								

●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1非面 積競争入 札(億円)	非競争 入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2022/7/27	2023/1/25	447,463.0	12,990.10		0.0000%	2.9031%		0.0000%		10.00

●オペ結果

種類	オフア額 (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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/7/14			13,949	4,756	▲0.004		▲0.002	12.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/7/14			8,569	5,007	▲0.010		▲0.008	41.2
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/7/14			1,232	501	▲0.016		▲0.013	82.4
国債買入(変動利付債)	300	2022/7/14			452	300	▲1.410		▲1.456	40.7
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オフア分))		2022/7/13	2022/7/14	▲0.450	11,023	11,023		▲0.450	▲0.450	
国債補充供給(国債売現先・即日(午後オフア分))		2022/7/13	2022/7/14	▲0.450	1	1		▲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		2022/7/14		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		2022/7/14		0.100	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ア。※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ア。

●2022年7月14日の予定

*6月の米生産者物価指数	*20年利付国債入札 (12,000億円、7/15発行)
--------------	---------------------------------

◆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