

Central Daily Market Report

2022年7月14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14日 需給速報	2022年7月15日 需給予想	2022年7月19日 当社予想
銀行券	▲ 1,000	0	500
財政	3,400	5,100	▲ 1,000
資金過不足	2,400	5,100	▲ 500
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
	スタート	エンド	スタート
	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	10,800		
CP等買入		▲ 400	▲ 800
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 100
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	▲ 9,800	11,100	9,800
※ドル資金供給用国債提供			
当増減	14,100	14,000	▲ 500
当座預金残高	5,443,300	5,457,300	5,456,800
準備預金残高	4,762,400		
積み終了先	4,762,400		7月15日以降の残り所要積立額
超過準備	4,762,400		積数
非準備預金先	680,900		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
			96.67%

●2022年7月14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。本日も積み最終日に向けた積極的な調達が見られた事で、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、▲0.150~▲0.085%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>

14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、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

2022/7/14	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	▲ 0.007				-	▲ 0.099	0.230	0.000	26,643.39	164.62	137.63-64	139.09-11	
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.102							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.012				-	▲ 0.134							
2W	▲ 0.030	0.180	▲ 0.002				-	▲ 0.141							
3W							-	▲ 0.141							
1M	▲ 0.035	0.020	▲ 0.010				-	▲ 0.144							
3M	0.000	0.010	0.003				▲ 0.152	▲ 0.151							
6M							▲ 0.190	▲ 0.140							
1Y							▲ 0.140	▲ 0.133							
									日付		7/7	7/8	7/11	7/12	7/13
									日銀当預残	5,475,900	5,477,000	5,479,300	5,470,400	5,429,200	
									準備預金残	4,788,100	4,793,500	4,790,300	4,777,900	4,746,600	
									マネタリーベース	6,727,000	6,728,000	6,729,500	6,720,500	6,679,300	
									無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.008%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.007%	
									コール市場残高	160,684	165,961	163,012	167,439	169,570	
									うち無担	131,087	135,988	135,653	139,428	139,598	
									うちO/N	60,889	66,390	65,255	69,080	69,615	
									うち有担	29,597	29,973	27,359	28,011	29,972	

●入札結果

名称	回数	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)	募入数(億)	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非価格競争入札(億円)
20年利付国債	181	0.900%	12,000	2022/7/15	2042/6/20	35,330.0	9,727.0	99,8500	0.9080%	6.2008%	99.9500	0.9020%	2,266.0

●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)		2022/7/14	2022/7/15	▲ 0.450	9,728	9,728		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/7/14	2022/7/15	▲ 0.450	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		2022/7/15		0.020	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		2022/7/15		0.105	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15日の予定

*5月の第3次産業活動指数	*6月の米小売売上高	*国庫短期証券(1094回)入札
*5月の石油等消費動態統計	*5月の米企業在庫	(3ヶ月、56,000億円、7/19発行)
	*6月の米鉱工業生産・設備稼働率	*交付税特別会計借入
	*7月のミシガン大消費者信頼感指数速報	(13,000億円、7/29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り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