

Central Daily Market Report

2022年7月15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15日 需給速報	2022年7月19日 需給予想	2022年7月20日 当社予想	
銀行券	0	900	▲ 1,000	
財政	2,000	6,800	▲ 2,300	
資金過不足	2,000	7,700	▲ 3,300	
金融調節				
	スタート	エンド	スタート	
貸出				
全店共通			▲ 3,100	
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入				
CP等買入	▲ 800	▲ 200		
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				
国債補完供給	▲ 9,400	9,400		
※ドル資金需給速報は別添資料				
当増増減	1,500	16,900	▲ 6,400	
当座預金残高	5,444,800	5,461,700	5,455,300	
準備預金残高	4,793,200			
積み終了先	4,793,200	7月19日以降の残り所要積立額	23,300	
超過準備	4,793,200	積数	800	
非準備預金先	651,600	1日平均	800	
積み期間(7/16~8/15)の所要準備額			3,870,200	
準備預金進捗率	実績	99.40%	日数	9.68%

●2022年7月15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▲0.02~▲0.005%の調達で始まった。積み最終日であると同時に、新しい積み期にかかる取引となる事から、前日までに比べ、レート目線はやや低下したものの、邦銀業態の調達を中心に▲0.02~▲0.008%での出会いとなった。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、▲0.105~▲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>

15日はTB3M物(第1094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しっかりと推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、幅広い業態が発行を実施し、大型発行も見られた。発行レートに大きな変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/7/15	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.093	0.230	0.000	26,788.47	145.08	138.97-98	138.91-93	
T/N			▲ 0.013				-	▲ 0.101							
S/N							-	-							
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.124							
2W	▲ 0.040	0.100	▲ 0.028				-	▲ 0.138							
3W			▲ 0.025				-	▲ 0.142							
1M			0.001				-	▲ 0.147							
3M							▲ 0.142	▲ 0.148							
6M							▲ 0.190	▲ 0.141							
1Y							▲ 0.140	▲ 0.136							
									日付		7/8	7/11	7/12	7/13	7/14
									日銀当預残	5,477,000	5,479,300	5,470,400	5,429,200	5,443,300	
									準備預金残	4,793,500	4,790,300	4,777,900	4,746,600	4,761,800	
									マネタリーベース	6,728,000	6,729,500	6,720,500	6,679,300	6,694,300	
									無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.007%	▲0.007%	
									コール市場残高	165,961	163,012	167,439	169,570	171,111	
									うち無担	135,988	135,653	139,428	139,598	141,567	
									うちO/N	66,390	65,255	69,080	69,615	72,094	
									うち有担	29,973	27,359	28,011	29,972	29,544	

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1094	-	56,000	2022/7/19	2022/10/17	127,616.0	45,289.2	100.0325	▲0.1317%	80.9887%	100.0342	▲0.1386%	10,710	
交付税特会	-	-	13,000	2022/7/29	2023/1/30	391,759.0	12,980.41	-	0.0000%	3.3134%	-	0.0000%	-	20.00

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/7/15	2022/7/19	▲ 0.350	9,269	9,269		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/7/15	2022/7/19	▲ 0.350	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		2022/7/19		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		2022/7/19		0.095	0	0				
社債等買入	1,000	2022/7/21			1,223	1,000	0.159		0.220	46.2

*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19日の予定

*6月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1095回)入札
*6月のユーロ圏消費者物価指数改定値	(1年、35,000億円、7/20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