

Central Daily Market Report

2022年7月19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19日 需給速報	2022年7月20日 需給予想	2022年7月21日 当社予想
銀行券	800	100	▲ 500
財政	5,600	▲ 2,900	▲ 5,000
資金過不足	6,400	▲ 2,800	▲ 5,500
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通		2,300	▲ 3,100
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		14,600	
CP等買入	▲ 200	▲ 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		▲ 100	1,000
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	▲ 9,200	9,400	9,200
※ドル資金供給用国債買入供給			
当増減	6,400	19,700	▲ 4,500
当座預金残高	5,451,200	5,470,900	5,466,400
準備預金残高	4,764,500		
積み終了先	4,758,000		
超過準備	4,757,800		
非準備預金先	686,700		
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	99.57%	日数
			12.90%

●2022年7月19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▲0.03~▲0.01%の調達で始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.130~▲0.090%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>

19日はTB1Y物(第1095回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、強含んで推移した。この他、3M物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、発行企業件数は多くないものの、大型発行が複数実施された。発行レートは、概ね横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/7/19	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)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.099	0.234	0.004	26,961.68	173.21	138.26-28	137.73-75
T/N			▲ 0.013				-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.122						
2W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.027				-	▲ 0.131						
3W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.025				-	▲ 0.140						
1M	▲ 0.033	▲ 0.013	▲ 0.021				-	▲ 0.144						
3M							▲ 0.145	▲ 0.147						
6M							▲ 0.190	▲ 0.140						
1Y							▲ 0.165	▲ 0.136						
日付		7/11	7/12	7/13	7/14	7/15								
日銀当預残		5,479,300	5,470,400	5,429,200	5,443,300	5,444,800								
準備預金残		4,790,300	4,777,900	4,746,600	4,761,800	4,792,300								
マネタリーベース		6,729,500	6,720,500	6,679,300	6,694,300	6,695,800								
無担O/N加重平均		▲ 0.010%	▲ 0.008%	▲ 0.007%	▲ 0.007%	▲ 0.014%								
コール市場残高		163,012	167,439	169,570	171,111	169,236								
うち無担		135,653	139,428	139,598	141,567	139,844								
うちO/N		65,255	69,080	69,615	72,094	73,156								
うち有担		27,359	28,011	29,972	29,544	29,392								

●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非償額競争入札(億円)
国庫短期証券	1095	-	35,000	2022/7/20	2023/7/20	102,637.0	28,307.90	100.1310	▲ 0.1308%	66.1925%	100.1310	▲ 0.1308%	6,692.0

●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
共通担保資金供給(全店) <固定金利方式>	20,000	2022/7/20	2022/8/3		2,301	2,301				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/7/20			5,710	4,752	▲ 0.014		▲ 0.007	80.9
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/7/20			10,794	4,754	▲ 0.002		▲ 0.001	37.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/7/20			11,267	5,013	0.001		0.002	70.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/7/19	2022/7/20	▲ 0.350	9,141	9,141		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/7/19	2022/7/20	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/7/21	2022/7/28	1.830	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		2022/7/20		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		2022/7/20		0.100	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20日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合(1日目、21日まで)	*6月の米中古住宅販売 *6月の英消費者物価指数	*国庫短期証券(1096回) (6ヶ月、24,000億円、7/25発行)	*流動性供給入札 (5,000億円、7/21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よう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等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