Central Daily Market Report

2022年7月20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20日 需給速報	2022年7月21日 需給予想	2022年7月22日 当社予想
銀行券	200	▲ 400	▲ 1,000
財政	▲ 800	▲ 8,200	4,000
資金過不足	▲ 600	▲ 8,600	3,000

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	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		▲ 400		▲ 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	1,000	▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ			16,000			
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 9,700	9,200		9,700		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	12,200		17,800		3,000	

当座預金残高	5,463,400	5,481,200	5,484,200
準備預金残高	4,762,100		
積み終了先	4,758,200	7月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,758,000	積数	12,500
非準備預金先	701,300	1日平均	500
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	99.68%	日数 16.13%

●2022年7月20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▲0.025～▲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、▲0.140～▲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>

20日はTB6M物（第1096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、堅調に推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、複数の入札が実施されており、調達規模は大小まちまちとなった。発行レートは、横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/7/20	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.014				－	▲ 0.103
T/N			▲ 0.010				－	▲ 0.138
S/N							－	－
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.011				－	▲ 0.141
2W	▲ 0.040	0.180	▲ 0.017				－	▲ 0.139
3W	▲ 0.038	0.000	▲ 0.023				－	▲ 0.146
1M			▲ 0.020				－	▲ 0.148
3M							▲ 0.152	▲ 0.148
6M							▲ 0.230	▲ 0.143
1Y							▲ 0.180	▲ 0.137

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	0.006	27,680.26	718.58	138.17-19	138.12-14

日付	7/12	7/13	7/14	7/15	7/19
日銀当預残	5,470,400	5,429,200	5,443,300	5,444,800	5,451,200
準備預金残	4,777,900	4,746,600	4,761,800	4,792,300	4,762,300
マネタリーベース	6,720,500	6,679,300	6,694,300	6,695,800	6,701,400
無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.007%	▲0.007%	▲0.014%	▲0.019%
コール市場残高	167,439	169,570	171,111	169,236	166,089
うち無担	139,428	139,598	141,567	139,844	136,464
うちO/N	69,080	69,615	72,094	73,156	73,586
うち有担	28,011	29,972	29,544	29,392	29,625

●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)
国庫短期証券	1096	－	24,000	2022/7/25	2023/1/25	82,794.0	19,413.0	100.0920	▲0.1823%	89.0000%	100.1070	▲0.2120%	4,587.0
流動性供給	361	－	5,000	2022/7/21	－	17,254.0	4,979.0	－	▲0.0020%	42.5903%	－	▲0.0040%	－

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/7/20	2022/7/21	▲ 0.350	9,573	9,573		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/20	2022/7/21	▲ 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		2022/7/21		0.016	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		2022/7/21		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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
気候変動対応支援オペ	2022/7/21	2023/7/21	0	15,953

●2022年7月21日の予定

*6月の貿易統計
*日銀政策委・金融政策決定会合（2日目、終了後、直ちに結果公表）
*黒田日銀総裁定例会見
*経済・物価情勢の展望
*ECB定例理事会（金融政策発表）

◆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