

Central Daily Market Report

2022年7月21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21日 需給速報	2022年7月22日 需給予想	2022年7月25日 当社予想
銀行券	▲ 400	▲ 400	0
財政	▲ 7,000	9,100	20,000
資金過不足	▲ 7,400	8,700	20,000

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000	▲ 100		▲ 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	16,000					
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 11,700	9,700		11,700		
※以下の資金供給は前日比変動あり						
当増減	7,300		20,200		20,000	

当座預金残高	5,470,700	5,490,900	5,510,900
準備預金残高	4,777,000		
積み終了先	4,774,100	7月22日以降の残り所要積立額	9,200
超過準備	4,773,800	積数	
非準備預金先	693,700	1日平均	400

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 99.76%	日数 19.35%

●短期金融市場関連指標

2022/7/21	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		
	単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.012					-	▲ 0.126	0.235	▲ 0.005	27,803.00	122.74	138.42-43	138.58-60
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.186						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.155						
2W	▲ 0.010	0.150	0.006					-	▲ 0.156						
3W			▲ 0.035					-	▲ 0.157						
1M	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.023					-	▲ 0.158						
3M								▲ 0.152	▲ 0.150						
6M								▲ 0.230	▲ 0.146						
1Y								▲ 0.180	▲ 0.142						
									日付		7/13	7/14	7/15	7/19	7/20
									日銀当預残		5,429,200	5,443,300	5,444,800	5,451,200	5,463,400
									準備預金残		4,746,600	4,761,800	4,792,300	4,762,300	4,762,100
									マネタリーベース		6,679,300	6,694,300	6,695,800	6,701,400	6,713,400
									無担O/N加重平均		▲ 0.007%	▲ 0.007%	▲ 0.014%	▲ 0.019%	▲ 0.014%
									コール市場残高		169,570	171,111	169,236	166,089	171,964
									うち無担		139,598	141,567	139,844	136,464	141,911
									うちO/N		69,615	72,094	73,156	73,586	77,028
									うち有担		29,972	29,544	29,392	29,625	30,053

●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)	発札総額 (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	平均発札レート ・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))		2022/7/21	2022/7/22	▲ 0.350	11,566	11,566		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先・即日(午後オファー分))		2022/7/21	2022/7/22	▲ 0.350	42	42		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/7/22		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		2022/7/22		0.090	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2022/7/22		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)※4		2022/7/22		0.090	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。
※3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。※4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。

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について
1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。
(1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)
① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。
短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
② 連続指値オペの運用
上記の金融市場調節方針を実現するため、10年物国債金利について0.25%の利回りでの指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。
(2) 資産買入れ方針(全員一致)
長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
① E T F および J - R E I T について、それぞれ年間約1.2兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
② C P 等、社債等については、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(C P 等: 約2兆円、社債等: 約3兆円)へと徐々に戻していく。

◆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