Central Daily Market Report

2022年7月22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22日 需給速報	2022年7月25日 需給予想	2022年7月26日 当社予想
銀行券	▲ 400	400	▲ 1,000
財政	7,800	24,200	5,000
資金過不足	7,400	24,600	4,000

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		▲ 100		▲ 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		▲ 100				
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 8,900	11,700		8,900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減		10,000		33,400		4,000

当座預金残高	5,480,700	5,514,100	5,518,100
準備預金残高	4,799,000		
積み終了先	4,798,300		
超過準備	4,797,600		
非準備預金先	681,700		

7月25日以降の残り所要積立額	
積数	5,000
1日平均	200

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	99.87%	日数 29.03%

●2022年7月22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▲0.020～▲0.005%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～▲0.080%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>

22日はTB3M物（第1097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市場は、複数の業態から入札が実施された。発行レートは、横ばい圏ながらも参加者の購入意欲は強い。

●短期金融市場関連指標

2022/7/22	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	▲ 0.009				－	▲ 0.102
T/N	▲ 0.009	▲ 0.008	▲ 0.009				－	▲ 0.155
S/N							－	－
1W	▲ 0.020	▲ 0.008	▲ 0.013				－	▲ 0.150
2W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				－	▲ 0.152
3W							－	▲ 0.154
1M	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.023				－	▲ 0.156
3M							▲ 0.154	▲ 0.153
6M							▲ 0.220	▲ 0.147
1Y							▲ 0.170	▲ 0.142

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）
0.215	▲ 0.020	27,914.66	111.66	137.08-09	137.58-60

日付	7/14	7/15	7/19	7/20	7/21
日銀当預残	5,443,300	5,444,800	5,451,200	5,463,400	5,470,700
準備預金残	4,761,800	4,792,300	4,762,300	4,762,100	4,777,000
マネタリーベース	6,694,300	6,695,800	6,701,400	6,713,400	6,721,100
無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.014%	▲0.019%	▲0.014%	▲0.012%
コール市場残高	171,111	169,236	166,089	171,964	173,776
うち無担	141,567	139,844	136,464	141,911	142,199
うちO/N	72,094	73,156	73,586	77,028	74,251
うち有担	29,544	29,392	29,625	30,053	31,577

●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)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1097	－	56,000	2022/7/25	2022/10/24	125,805.0	45,287.4	100.0360	▲0.1443%	81.5694%	100.0381	▲0.1527%	10,712.2	
流動性供給	362	－	5,000	2022/7/25	－	18,276.0	4,993.0	－	▲0.0260%	77.2058%	－	▲0.0270%	－	
交付税特会	－	－	12,000	2022/8/2	2023/2/2	407,805.0	11,990.10	－	0.0000%	2.9402%	－	0.0000%	－	10.00

●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）		2022/7/22	2022/7/25	▲ 0.450	8,460	8,460		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/22	2022/7/25	▲ 0.450	389	389		▲0.450	▲0.450	
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/7/25		0.015	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		2022/7/25		0.105	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。

●2022年7月25日の予定

*特にありません

◆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