Central Daily Market Report

2022年7月25日（月）
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25日 需給速報		2022年7月26日 需給予想		2022年7月27日 当社予想	
銀行券	300		▲ 500		▲ 500	
財政	25,100		2,700		▲ 12,000	
資金過不足	25,400		2,200		▲ 12,500	
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			16,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 600		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
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	▲ 8,400	8,900		8,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	25,800		25,900		▲ 12,500	

当座預金残高	5,506,500	5,532,400	5,519,900
準備預金残高	4,824,500		
積み終了先	4,823,800	7月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,823,800	積数	4,300
非準備預金先	682,000	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 99.89%	日数	32.26%

●2022年7月25日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落した事もあり、一部にビッドレートを引き下げる動きが見られた。一方で、大手行からの資金調達ニーズが堅調なため、相場の下支えとなり、レート水準は先週末対比で若干の低下に留まった。立ち上がりは、邦銀業態を中心に▲0.02～▲0.005%近辺の水準で出合いが見られた。一巡後も、同程度の水準で散発的な出合いが見られた。
ターム物は、ショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.120～▲0.100%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>

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、複数の業態から入札が実施され、一部で大型発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/7/25	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	▲ 0.010				－	▲ 0.095
T/N	▲ 0.009	▲ 0.008	▲ 0.009				－	▲ 0.123
S/N							－	－
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.006				－	▲ 0.139
2W			▲ 0.012				－	▲ 0.146
3W							－	▲ 0.150
1M			0.010				－	▲ 0.153
3M							▲ 0.154	▲ 0.150
6M							▲ 0.220	▲ 0.149
1Y							▲ 0.170	▲ 0.144

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）
0.198	▲ 0.017	27,699.25	▲ 215.41	136.34-36	136.40-41

日付	7/15	7/19	7/20	7/21	7/22
日銀当預残	5,444,800	5,451,200	5,463,400	5,470,700	5,480,700
準備預金残	4,792,300	4,762,300	4,762,100	4,777,000	4,799,000
マネタリーベース	6,695,800	6,701,400	6,713,400	6,721,100	6,731,500
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.019%	▲0.014%	▲0.012%	▲0.009%
コール市場残高	169,236	166,089	171,964	173,776	179,668
うち無担	139,844	136,464	141,911	142,199	148,724
うちO/N	73,156	73,586	77,028	74,251	76,811
うち有担	29,392	29,625	30,053	31,577	30,944

●入札結果

本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。

●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
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,750	2022/7/26			12,641	4,752	▲0.006		▲0.006	77.1
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,750	2022/7/26			13,616	4,755	▲0.020		▲0.019	55.2
国債買入（残存期間5年超10年以下）	5000	2022/7/26			7,610	5,001	▲0.047		▲0.039	100.0
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1250	2022/7/26			6108	1,259	▲0.037		▲0.035	10.9
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/7/25	2022/7/26	▲ 0.350	8,244	8,244		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/25	2022/7/26	▲ 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		2022/7/26		0.035	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		2022/7/26		0.140	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26日の予定

*月例経済報告
*金融政策決定会合議事要旨（6月16、17日分）
*6月の企業向けサービス価格指数
*米FOMC（1日目）
*6月の米新築一戸建て販売件数
*5月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*7月の米CB消費者信頼感指数
*40年利付国債入札
（7,000億円、7/27発行）

◆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