

# Central Daily Market Report

2022年7月26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26日 需給速報	2022年7月27日 需給予想	2022年7月28日 当社予想	
銀行券	▲ 500	▲ 200	▲ 1,000	
財政	3,000	▲ 8,800	6,000	
資金過不足	2,500	▲ 9,000	5,000	
金融調節				
貸出				
全店共通				
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入		1,000		
国債買入	16,100			
CP等買入		▲ 600	▲ 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		
新型コロナウイルス対応金融支援特別				
気候変動対応オペ				
ETF買入				
国債補充供給	▲ 8,200	8,400	8,200	
米ドル資金供給(米債国債国債供給)				
当増増減	18,000	▲ 400	5,000	
当座預金残高	5,524,500	5,524,100	5,529,100	
準備預金残高	4,852,600			
積み増し先	4,851,900			
超過準備	4,851,900			
非準備預金先	671,900			
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	99.91%	日数	35.48%

## ●2022年7月26日の市場動向

### ＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、引き続き大手行の堅調な資金調達ニーズが相場を下支えする展開となった。レート水準は前日比概ね横ばい圏での推移となり、邦銀業態を中心に▲0.015~▲0.005%近辺での出会いとなった。一巡後も、朝方と同程度の水準で散発的な出会いが見られた。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、▲0.130~▲0.100%程度での出会い。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＞

26日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、甘めの結果となった。マーケットでは1Y物に出会いが見られた。

### ＜CP市場＞

CP市場は、多くの業態から入札が実施され、複数の大型発行が見られた。発行レートに大きな変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2022/7/26	無担(速報)			有担(速報)			短国 発表参考統計値	東京 レポレート 平均値
	最低	最高	平均	最低	最高	平均		
O/N	▲ 0.045	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.093
T/N	▲ 0.009	▲ 0.008	▲ 0.009				-	▲ 0.112
S/N							-	-
1W	▲ 0.040	▲ 0.006	▲ 0.027				-	▲ 0.134
2W	▲ 0.025	▲ 0.007	▲ 0.014				-	▲ 0.139
3W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.015				-	▲ 0.148
1M	▲ 0.040	0.250	0.043				-	▲ 0.150
3M							▲ 0.154	▲ 0.150
6M							▲ 0.220	▲ 0.148
1Y							▲ 0.160	▲ 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)
0.205	0.007	27,655.21	▲ 44.04	136.40-42	136.65-67

  

日付	7/19	7/20	7/21	7/22	7/25
日銀当預残	5,451,200	5,463,400	5,470,700	5,480,700	5,506,500
準備預金残	4,762,300	4,762,100	4,777,000	4,799,000	4,824,500
マネタリーベース	6,701,400	6,713,400	6,721,100	6,731,500	6,756,900
無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.014%	▲0.012%	▲0.009%	▲0.010%
コール市場残高	166,089	171,964	173,776	179,668	185,094
うち無担	136,464	141,911	142,199	148,724	155,796
うちO/N	73,586	77,028	74,251	76,811	81,228
うち有担	29,625	30,053	31,577	30,944	29,298

## ●入札結果

名称	回数	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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
40年利付国債	15	1.000%	7,000	2022/7/27	2062/3/20	18,931.0	6,999.00	89,4300	1.3450%	40.0584%			

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/7/27			7,380	1,000		0.026	0.026	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/7/26	2022/7/27	▲ 0.350	8,062	8,062		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/7/26	2022/7/27	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給		2022/7/28	2022/8/4	2.500	1	1				
CP等買入	4,000	2022/7/29			11,147	3,977	0.000		0.019	51.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/7/27		0.052	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		2022/7/27		0.171	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。

## ●2022年7月27日の予定

\*5月の景気動向指数改訂状況

\*米FOMC(2日目)

\*6月の米耐久財新規受注

◆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。

◆本資料は向から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自身で行なわ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