Central Daily Market Report

2022年7月27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27日 需給速報	2022年7月28日 需給予想	2022年7月29日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 1,300	▲ 1,100
財政	▲ 9,100	1,600	3,600
資金過不足	▲ 9,400	300	2,500

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	1,000					
国債買入						
CP等買入		▲ 600		▲ 200	4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 123,500
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 9,000	8,200		9,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 9,800		9,100		▲ 117,000	

当座預金残高	5,514,700	5,523,800	5,406,800
準備預金残高	4,842,400		
積み終了先	4,841,700		
超過準備	4,841,700		
非準備預金先	672,300		

7月28日以降の残り所要積立額	
積数	2,900
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	99.93%	日数 38.71%

●2022年7月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き大手行の資金調達ニーズは堅調で、レート水準は高い。朝方は前日に比べ一部にやや高めのビッドも見られたが、邦銀業態の▲0.010～▲0.005%近辺での出合いが中心となり、全般的には概ね横ばい圏での推移となった。また、一巡後も、同水準で散発的な出合いとなった。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、▲0.140～▲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>

27日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

<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。大型案件の一部で小幅な金利上昇がみられた。

●短期金融市場関連指標

2022/7/27	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	▲ 0.040	0.001	▲ 0.010				－	▲ 0.093
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009				－	▲ 0.118
S/N							－	－
1W	▲ 0.010	▲ 0.009	▲ 0.009				－	▲ 0.134
2W			▲ 0.025				－	▲ 0.137
3W							－	▲ 0.145
1M			0.001				－	▲ 0.149
3M							▲ 0.154	▲ 0.150
6M							▲ 0.220	▲ 0.147
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）
0.200	▲ 0.005	27,715.75	60.54	136.96-97	136.97-99

日付	7/20	7/21	7/22	7/25	7/26
日銀当預残	5,463,400	5,470,700	5,480,700	5,506,500	5,524,500
準備預金残	4,762,100	4,777,000	4,799,000	4,824,500	4,852,600
マネタリーベース	6,713,400	6,721,100	6,731,500	6,756,900	6,775,400
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.012%	▲0.009%	▲0.010%	▲0.010%
コール市場残高	171,964	173,776	179,668	185,094	187,414
うち無担	141,911	142,199	148,724	155,796	158,051
うちO/N	77,028	74,251	76,811	81,228	83,103
うち有担	30,053	31,577	30,944	29,298	29,363

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第Ⅰ非価格競争入札(億円)
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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/7/27	2022/7/28	▲ 0.350	8,852	8,852		▲0.350	▲0.352	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/27	2022/7/28	▲ 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		2022/7/28		0.045	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		2022/7/28		0.180	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28日の予定

*4-6月期の米GDP速報値

*2年利付国債入札
（28,000億円、8/1発行）
*交付税特別会計借入
（12,000億円、8/10借入）

◆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