

Central Daily Market Report

2022年7月28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28日 需給速報	2022年7月29日 需給予想	2022年8月1日 当社予想
銀行券	▲ 1,300	▲ 100	1,000
財政	1,500	10,400	▲ 11,000
資金過不足	200	10,300	▲ 10,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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	4,000	▲ 2,900
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 600
新型コロナウイルス対応金融支援特別		6,000	▲ 123,500
気候変動対応オペ			
ETF買入			
国債補充供給	▲ 11,200	9,000	11,200
※ドル資金需給速報は別途発表			
当増減	▲ 2,200	▲ 95,500	▲ 10,000
当座預金残高	5,512,500	5,417,000	5,407,000
準備預金残高	4,828,700		
積み終了先	4,828,000		7月29日以降の残り所要積立額
超過準備	4,828,000		積数
非準備預金先	683,800		1日平均
			100
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	99.94%	日数
			41.94%

●2022年7月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、引き続き大手行の資金調達ニーズが堅調であり、レート水準は高止まりとなった。朝方は、邦銀業態を中心に▲0.010~▲0.005%近辺での出合いが見られ、概ね前日と横ばい圏での推移であった。また、一巡後も同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、▲0.20%近辺での出合いが見られるなど、オファーサイドが薄く、強含みで推移する展開となった。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>

28日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP市場は、大型を含めて複数の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●2022年7月29日の予定

*決定会合における主な意見(7月20、21日分)

*6月の完全失業率(市場予想：2.5%)

*7月の都区部消費者物価指数(CPI)
(市場予想：前年同月比(除く生鮮)+2.2%)

*6月の有効求人倍率(市場予想：1.25倍)

*6月の商業動態統計速報

*6月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想：前月比+3.7%)

*6月の住宅着工統計

*7月の消費動向調査

*6月の米個人所得・消費支出

*7月のシカゴPM景況感指数

*7月のユーロ圏消費者物価指数速報値

*4-6月期のユーロ圏GDP1次速報

*国庫短期証券(1098回)入札(3ヶ月、56,000億円、8/1発行)

●短期金融市場関連指標

2022/7/28	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均			直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.040	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.140	0.200	0.000	27,815.48	99.73	136.11-12	135.57-59
T/N	▲ 0.050	▲ 0.008	▲ 0.013				-	▲ 0.204						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.170						
2W							-	▲ 0.163						
3W							-	▲ 0.159						
1M	▲ 0.018	0.000	▲ 0.011				-	▲ 0.158						
3M							▲ 0.154	▲ 0.150						
6M							▲ 0.220	▲ 0.150						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.144						
									日付	7/21	7/22	7/25	7/26	7/27
									日銀当預残	5,470,700	5,480,700	5,506,500	5,524,500	5,514,700
									準備預金残	4,777,000	4,799,000	4,824,500	4,852,600	4,842,500
									マネタリーベース	6,721,100	6,731,500	6,756,900	6,775,400	6,765,900
									無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.009%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.010%
									コール市場残高	173,776	179,668	185,094	187,414	188,649
									うち無担	142,199	148,724	155,796	158,051	159,401
									うちO/N	74,251	76,811	81,228	83,103	83,318
									うち有担	31,577	30,944	29,298	29,363	29,248

●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1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
2年利付国債	439	0.005%	28,000	2022/8/1	2024/8/1	98,095.0	22,642.0	100,155.0	▲0.0720%	62.1910%	100.1590	▲0.0740%	5,352	
交付税特会	-	-	12,000	2022/8/10	2023/2/8	391,771.0	11,990.09	-	0.0000%	3.0605%	-	0.0000%	-	10,000

●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)	着札総額(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	平均着札レート・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)		2022/7/28	2022/7/29	▲ 0.350	11,016	11,016		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/7/28	2022/7/29	▲ 0.350	20	20		▲ 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		2022/7/29		0.050	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		2022/7/29		0.187	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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
新型コロナウイルス対応金融支援特別	2022/7/29	2023/1/27	0	4,197
新型コロナウイルス対応金融支援特別	2022/7/29	2023/1/27	0	1,776

(参考)2022/7/29時点の貸出残高(億円)	
制度融資分(2022/4/1以降実行)	19,269
プロパー融資分(2022/4/1以降実行)	4,004
2022/3/31以前に実行された貸付け	492,703
合計	515,976

◆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