

Central Daily Market Report

2022年7月29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29日 需給速報		2022年8月1日 需給予想		2022年8月2日 当社予想	
銀行券	▲ 100		400		1,000	
財政	10,300		▲ 19,600		▲ 11,000	
資金過不足	10,200		▲ 19,200		▲ 10,000	
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			11,000			
CP等買入	4,000	▲ 2,900		▲ 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		▲ 600				
新型コロナ対応金融支援特別	6,000	▲ 123,500				
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 9,800	11,200		9,800		
※ドル資金供給額(国債供給額)						
当増減	▲ 105,400		1,500		▲ 10,000	
当座預金残高	5,407,100		5,408,600		5,398,600	
準備預金残高	4,728,200					
積み終了先	4,727,700		8月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,727,600		積数		500	
非準備預金先	678,900		1日平均		0	
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	99.99%	日数	51.61%		

●2022年7月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/Nは、週末・月末要因による変化は特段見られず、引き続き大手行の資金調達ニーズが堅調であったことから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%近辺での出会いが見られた。また、一巡後も同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、▲0.150~▲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>

29日はTB3M物(第1098回)の入札が実施され、やや弱めの結果となったが、結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、案件少なく、閑散とした展開に終始した。

●短期金融市場関連指標

2022/7/29	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.035	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.115	0.175	▲ 0.025	27,801.64	▲ 13.84	134.38-40	132.77-79
T/N			▲ 0.009				-	▲ 0.137						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.020	0.000	▲ 0.015				-	▲ 0.148						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.019				-	▲ 0.148						
3W							-	▲ 0.149						
1M	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.033				-	▲ 0.154						
3M							▲ 0.142	▲ 0.150						
6M							▲ 0.220	▲ 0.149						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.144						
									日付	7/22	7/25	7/26	7/27	7/28
									日銀当預残	5,480,700	5,506,500	5,524,500	5,514,700	5,512,500
									準備預金残	4,799,000	4,824,500	4,852,600	4,842,500	4,828,700
									マネタリーベース	6,731,500	6,756,900	6,775,400	6,765,900	6,765,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.010%
									コール市場残高	179,668	185,094	187,414	188,649	187,640
									うち無担	148,724	155,796	158,051	159,401	158,529
									うちO/N	76,811	81,228	83,103	83,318	82,181
									うち有担	30,944	29,298	29,363	29,248	29,111

●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	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)
国庫短期証券	1098	-	56,000	2022/8/1	2022/10/31	113,624.0	45,377.7	100.0330	▲0.1323%	42.3116%	100.0354	▲0.1419%	10,622.0

●オペ結果

種類	オフア額(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)	投分レート・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	投分比率
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/8/1			15,343	4,758	▲0.013		0.006	11.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/8/1			10,201	5,007	▲0.020		▲0.018	36.6
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/8/1			1,733	504	▲0.006		▲0.006	56.6
国債買入(物価連動債)	600	2022/8/1			2,289	601	▲0.250		▲0.431	14.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/7/29	2022/8/1	▲ 0.450	8,374	8,374		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/7/29	2022/8/1	▲ 0.450	1,245	1,245		▲ 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		2022/8/1		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		2022/8/1		0.186	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ア。※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ア。

●2022年8月1日の予定

*6月の米建設支出
*7月のISM製造業景況指数

◆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