Central Daily Market Report

2022年7月4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4日 需給速報		2022年7月5日 需給予想		2022年7月6日 当社予想	
銀行券	600		▲ 100		500	
財政	▲ 38,800		400		▲ 26,000	
資金過不足	▲ 38,200		300		▲ 25,500	
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						▲ 4,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入	600		300			
国債補完供給	▲ 15,900	19,800		15,900		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 33,700		16,400		▲ 30,000	
当座預金残高	5,486,200		5,502,600		5,472,600	
準備預金残高	4,806,100					
積み終了先	4,806,100					
超過準備	4,806,000					
非準備預金先	680,100					

7月5日以降の残り所要積立額	
積数	200
1日平均	0

積み期間（6/16～7/15）の所要準備額	3,743,800

準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	63.33%

●2022年7月4日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O／N物は、邦銀を中心に▲0.03～▲0.015%の調達で始まった。一巡後も同水準での取引が続き、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームの出合いが散見される程度であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15～▲0.10%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>

4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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/7/4	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.022				－	▲ 0.095
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.109
S/N							－	－
1W			▲ 0.024				－	▲ 0.137
2W	▲ 0.045	▲ 0.003	▲ 0.024				－	▲ 0.143
3W							－	▲ 0.146
1M	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.029				－	▲ 0.149
3M							▲ 0.142	▲ 0.144
6M							▲ 0.135	▲ 0.134
1Y							▲ 0.125	▲ 0.129

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)
0.219	0.004	26,153.81	218.19	135.01-03	135.44-46

日付	6/27	6/28	6/29	6/30	7/1
日銀当預残	5,634,300	5,523,300	5,520,800	5,523,100	5,519,900
準備預金残	4,959,800	4,860,000	4,848,500	4,856,400	4,848,900
マネタリーベース	6,883,600	6,772,900	6,771,000	6,774,200	6,771,200
無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.039%	▲0.033%	▲0.040%	▲0.026%
コール市場残高	163,462	163,611	163,449	136,984	156,094
うち無担	134,522	133,677	135,062	111,871	130,510
うちO/N	56,464	55,739	58,287	72,196	68,925
うち有担	28,940	29,934	28,387	25,113	25,584

●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）		2022/7/4	2022/7/5	▲0.450	15,323	15,323		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/7/4	2022/7/5	▲0.450	500	500		▲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		2022/7/5			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		2022/7/5			0	0				

※1国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）の固定利回較差は、0.010%。この結果、10年利付国債364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国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）の固定利回較差は、0.087%。この結果、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5日の予定

*7月の日銀当座預金増減要因見込み
*5月の毎月勤労統計調査速報
*5月の米製造業新規受注・出荷・在庫
*10年利付国債入札（27,000億円、7/6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