

Central Daily Market Report

2022年7月6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6日 需給速報	2022年7月7日 需給予想	2022年7月8日 当社予想			
銀行券	300	▲ 700	500			
財政	▲ 27,400	1,700	▲ 9,000			
資金過不足	▲ 27,100	1,000	▲ 8,500			
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	3,100	▲ 4,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			12,500			
CP等買入		▲ 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						
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						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 16,700	16,300	16,700			
※ドル資金供給額(国債補充供給)						
当増減	▲ 28,000	30,200	▲ 8,500			
当座預金残高	5,460,200	5,490,400	5,481,900			
準備預金残高	4,780,200					
積み終了先	4,780,100			7月7日以降の残所要積立額		
超過準備	4,780,100			積数	100	
非準備預金先	680,000			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	100.00%	日数	70.00%		

●2022年7月6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～▲0.007%の調達で始まった。調達ニーズは強く、一巡後は▲0.015～▲0.007%近辺での出会いが続き、本日の取引を終えた。ターム物は、ショートタームの出会いが散見される程度であった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、▲0.20～▲0.11%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＞

6日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜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

2022/7/6	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	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	売買参考レート	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.012					-	▲ 0.106	0.245	▲ 0.005	26,107.65	▲ 315.82	135.54-55	135.42-44
T/N			▲ 0.014					-	▲ 0.170						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.010					-	▲ 0.169						
2W			▲ 0.025					-	▲ 0.165						
3W								-	▲ 0.163						
1M								-	▲ 0.167						
3M								▲ 0.142	▲ 0.149						
6M								▲ 0.135	▲ 0.135						
1Y								▲ 0.130	▲ 0.132						
										日付	6/29	6/30	7/1	7/4	7/5
										日銀当預残	5,520,800	5,523,100	5,519,900	5,486,200	5,488,200
										準備預金残	4,848,500	4,856,400	4,848,900	4,806,100	4,809,300
										マネタリーベース	6,771,000	6,774,200	6,771,200	6,736,800	6,739,100
										無担O/N加重平均	▲ 0.033%	▲ 0.040%	▲ 0.026%	▲ 0.022%	▲ 0.016%
										コール市場残高	163,449	136,984	156,094	161,404	163,114
										うち無担	135,062	111,871	130,510	131,525	135,413
										うちO/N	58,287	72,196	68,925	64,370	67,018
										うち有担	28,387	25,113	25,584	29,879	27,701

●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 還額入札(億円)	非償 入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2022/7/20	2023/1/19	474,571.0	12,990.11		0.0000%	2.7373%		0.0000%		10.00

●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2022/7/7			1,530	1,500	▲0.030		▲0.009	92.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,750	2022/7/7			15,663	4,755	▲0.002		0.000	42.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/7/7			15,265	4,756	▲0.005		▲0.004	22.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/7/7			3,825	1,255	▲0.007		▲0.005	10.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/7/6	2022/7/7	▲ 0.450	16,106	16,106		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/7/6	2022/7/7	▲ 0.450	491	491		▲ 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		2022/7/7		0	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		2022/7/7		0.085	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7日の予定

*6月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *5月の景気動向指数速報	*5月の米貿易収支	*国庫短期証券(1092回)入札(6ヶ月、24,000億円、7/11発行) *30年利付国債入札(9,000億円、7/8発行)
--------------------------------------	-----------	--

◆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