

Central Daily Market Report

2022年6月1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6月1日 需給速報	2022年6月2日 需給予想	2022年6月3日 当社予想
銀行券	400	▲ 200	1,000
財政	▲ 57,300	▲ 45,400	▲ 20,300
資金過不足	▲ 56,900	▲ 45,600	▲ 19,300

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	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	5,000							
国債買入								
CP等買入				▲ 100				
貸出支援基金(成)					3,200	▲ 5,200		
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 感染症対応 ETF買入								
国債補完供給	▲ 2,700	2,200		2,700				
※少額資金供給用国債提供								
当預増減	▲ 52,400		▲ 43,000		▲ 21,300			

当座預金残高	5,435,500	5,392,500	5,371,200
準備預金残高	4,757,900		
積み終了先	4,757,900		6月2日以降の残り所要積立額
超過準備	4,757,600		積数
非準備預金先	677,600		1日平均
			0
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額			3,873,000
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数
			54.84%

●短期金融市場関連指標

2022/6/1 単位：%	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
	最低	最高	平均	最低	最高	平均		
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.029				-	▲ 0.093
T/N	▲ 0.020	▲ 0.013	▲ 0.017				-	▲ 0.089
S/N							-	-
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.024				-	▲ 0.097
2W	▲ 0.040	0.100	▲ 0.030				-	▲ 0.101
3W							-	▲ 0.107
1M							-	▲ 0.116
3M							▲ 0.104	▲ 0.113
6M							▲ 0.105	▲ 0.112
1Y							▲ 0.105	▲ 0.111

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)
0.230	▲ 0.005	27,457.89	178.09			128.74-75	129.39-41
日付		5/25	5/26	5/27	5/30	5/31	
日銀当預残	5,539,800	5,567,300	5,500,000	5,477,100	5,487,900		
準備預金残	4,857,700	4,890,300	4,821,800	4,801,500	4,811,100		
マネタリーベース	6,785,900	6,814,500	6,747,300	6,723,900	6,734,000		
無担O/N加重平均	▲ 0.020%	▲ 0.019%	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.026%		
コール市場残高	214,706	221,434	239,417	220,542	186,453		
うち無担	184,397	191,276	208,619	189,356	157,993		
うちO/N	91,879	97,858	116,926	99,063	70,790		
うち有担	30,309	30,158	30,798	31,186	28,460		

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非償付競争入札(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)	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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)		2022/6/1	2022/6/2	▲ 0.350	2,610	2,610		▲ 0.350	▲ 0.035	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)		2022/6/1	2022/6/2	▲ 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)※		2022/6/2			0	0				

※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、0.015%。この結果、10年利付国債366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ー。

●2022年6月2日の予定

*札幌市金融経済懇話会において 安達審議委員講演 *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み *5月のマネタリーベース	*4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、6/3発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、6/10借入)
---	--------------------	---

◆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等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