

Central Daily Market Report

2022年6月2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6月2日 需給速報	2022年6月3日 需給予想	2022年6月6日 当社予想
銀行券	▲ 200	500	2,000
財政	▲ 41,300	▲ 28,800	3,000
資金過不足	▲ 41,500	▲ 28,300	5,000

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						
CP等買入		▲ 100		▲ 200		
貸出支援基金(成)			3,200	▲ 4,500		
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
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						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 1,500	2,700		1,500		
※ドル資産売却用国債国債供給						
当増減	▲ 40,400	▲ 28,400				5,000

当座預金残高	5,395,100	5,366,700	5,371,700
準備預金残高	4,720,000		
積み終了先	4,720,000		
超過準備	4,720,000		
非準備預金先	675,100		

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	58.06%

●2022年6月2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▲0.05～▲0.03%での調達で始まった。積み込みの後半に入ったばかりではあるものの調達量を調整する先も多く、引き続きレート水準は小幅な低下傾向となっている。一巡後も同水準で推移し本日の取引を終えた。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、▲0.090～▲0.080%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＞

2日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/6/2	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.034						0.240	0.010	27,413.88	▲ 44.01	130.12-15	129.88-90
T/N	▲ 0.020	▲ 0.015	▲ 0.018											
S/N			▲ 0.005											
1W														
2W	▲ 0.048	▲ 0.023	▲ 0.036											
3W														
1M			▲ 0.010											
3M														
6M														
1Y														

日付	5/26	5/27	5/30	5/31	6/1
日銀当預残	5,567,300	5,500,000	5,477,100	5,487,900	5,435,500
準備預金残	4,890,300	4,821,800	4,801,500	4,811,100	4,757,900
マネタリーベース	6,814,500	6,747,300	6,723,900	6,734,000	6,681,200
無担O/N加重平均	▲ 0.019%	▲ 0.021%	▲ 0.022%	▲ 0.026%	▲ 0.029%
コール市場残高	221,434	239,417	220,542	186,453	195,131
うち無担	191,276	208,619	189,356	157,993	165,589
うちO/N	97,858	116,926	99,063	70,790	84,736
うち有担	30,158	30,798	31,186	28,460	29,542

●入札結果

名称	回数	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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	366	0.200%	27,000	2022/6/3	2032/3/20	106,675.0	21,951.0	99,600.0	0.2410%	7.2951%	99.6200	0.2390%	5,036.0	4.05
交付税特会	-	-	13,000	2022/6/10	2022/12/9	503,954.0	12,980.22	-	0.0000%	2.5757%	-	0.0000%	-	20.00

●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)	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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/6/2	2022/6/3	▲ 0.350	1,499	1,499		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/6/2	2022/6/3	▲ 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)※		2022/6/3			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、0.020%。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ア。

●2022年6月3日の予定

*6月の日銀当座預金増減要因見込み	*5月の米雇用統計 *5月のISM 非製造業景況指数	*国庫短期証券(1084回)入札 (3ヶ月、59,000億円、6/6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る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