Central Daily Market Report

2022年6月6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6月6日 需給速報	2022年6月7日 需給予想	2022年6月8日 当社予想
銀行券	900	700	1,000
財政	900	3,500	▲ 10,500
資金過不足	1,800	4,200	▲ 9,500

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						▲ 5,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	11,500					
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		▲ 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						
国債補完供給	▲ 2,400	1,200		2,400		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	11,900		6,600		▲ 14,800	

当座預金残高	5,379,300	5,385,900	5,371,100
準備預金残高	4,721,700		
積み終了先	4,721,700		
超過準備	4,721,700		
非準備預金先	657,600		

6月7日以降の残り所要積立額	
積数	100
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	100.00%	日数 70.97%

●2022年6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、先週末に比べやや低下した水準での取引となった。立ち上がりは、邦銀業態より▲0.06～▲0.035%近辺での調達で始まった。一巡後は、▲0.06～▲0.04%近辺での出合いが中心となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>
GC T/Nは、▲0.080%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>
6日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物と6M物で出合いが見られた。

<CP市場>
CP市場は、入札が複数実施されたものの件数が少なかった。発行レートは、概ね横ばいであった。

●短期金融市場関連指標

2022/6/6	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.043				－	▲ 0.091
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.084
S/N							－	－
1W	▲ 0.055	▲ 0.020	▲ 0.045				－	▲ 0.089
2W	▲ 0.053	▲ 0.020	▲ 0.040				－	▲ 0.095
3W							－	▲ 0.102
1M			▲ 0.020				－	▲ 0.109
3M							▲ 0.093	▲ 0.111
6M							▲ 0.110	▲ 0.112
1Y							▲ 0.110	▲ 0.112

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）
0.240	0.010	27,915.89	154.32	130.72-75	130.76-78

日付	5/30	5/31	6/1	6/2	6/3
日銀当預残	5,477,100	5,487,900	5,435,500	5,395,100	5,367,400
準備預金残	4,801,500	4,811,100	4,757,900	4,720,000	4,706,800
マネタリーベース	6,723,900	6,734,000	6,681,200	6,641,000	6,612,600
無担O/N加重平均	▲0.022%	▲0.026%	▲0.029%	▲0.034%	▲0.039%
コール市場残高	220,542	186,453	195,131	193,736	171,837
うち無担	189,356	157,993	165,589	164,028	142,132
うちO/N	99,063	70,790	84,736	80,965	64,889
うち有担	31,186	28,460	29,542	29,708	29,705

●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）		2022/6/6	2022/6/7	▲ 0.350	2,384	2,384		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/6/6	2022/6/7	▲ 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）※		2022/6/7			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ァー。

●2022年6月7日の予定

*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引
*4月の全世帯家計調査
（市場予想：消費支出、前年比▲0.8%）
*4月の毎月勤労統計調査速報
*4月の景気動向指数速報
*4月の米貿易収支
*4月の米消費者信用残高
*30年利付国債入札
（9,000億円、6/8発行）
*交付税特別会計借入
（13,000億円、6/17借入）

◆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