

Central Daily Market Report

2022年6月7日(火)
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7日 需給速報	2022年6月8日 需給予想	2022年6月9日 当社予想
銀行券	700	600	0
財政	4,000	▲ 5,600	▲ 3,000
資金過不足	4,700	▲ 5,000	▲ 3,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			4,000 ▲ 5,300
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		5,000	
国債買入		900	
CP等買入			▲ 200
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			
ETF買入			
国債補充供給	▲ 1,900	2,400	1,900
米ドル資金供給(国債担保供給)			
当増減	5,200	1,300	▲ 3,000
当座預金残高	5,384,500	5,385,800	5,382,800
準備預金残高	4,723,100		
積み終了先	4,723,100		6月8日以降の残り所要積立額
超過準備	4,723,100		積数
非準備預金先	661,400		1日平均
			0
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額			3,871,700
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数
			74.19%

●2022年6月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続きビッドレートを引き下げる動きが見られ、昨日に比べ出合い水準はやや低下した。立ち上がりは、邦銀業態より▲0.065~▲0.04%近辺での調達が見られた。一巡後は、▲0.06~▲0.035%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>

7日は短国買入オペが前回と同額の5,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、件数が少なかったものの大型の案件が実施された。発行レートは、概ね横ばいで小動きであった。

●短期金融市場関連指標

2022/6/7 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	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			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	▲ 0.045				-	▲ 0.083	0.245	0.005	27,943.95	28.06	132.18-20	132.76-78	
T/N	▲ 0.045	▲ 0.009	▲ 0.035				-	▲ 0.083							
S/N			▲ 0.005				-	-							
1W			▲ 0.030				-	▲ 0.089							
2W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.032				-	▲ 0.094							
3W							-	▲ 0.101							
1M							-	▲ 0.109							
3M							▲ 0.093	▲ 0.111							
6M							▲ 0.110	▲ 0.112							
1Y							▲ 0.110	▲ 0.112							
									日付		5/31	6/1	6/2	6/3	6/6
									日銀当預残	5,487,900	5,435,500	5,395,100	5,367,400	5,379,300	
									準備預金残	4,811,100	4,757,900	4,720,000	4,706,800	4,721,500	
									マネタリーベース	6,734,000	6,681,200	6,641,000	6,612,600	6,623,600	
									無担O/N加重平均	▲0.026%	▲0.029%	▲0.034%	▲0.039%	▲0.043%	
									コール市場残高	186,453	195,131	193,736	171,837	158,768	
									うち無担	157,993	165,589	164,028	142,132	128,504	
									うちO/N	70,790	84,736	80,965	64,889	52,041	
									うち有担	28,460	29,542	29,708	29,705	30,264	

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	74	1.000%	9,000	2022/6/8	2052/3/20	22,608.0	7,265.0	98,7500	1.0550%	49.1048%	98.8800	1.0490%	1,724.0	
交付税特会	-	-	13,000	2022/6/17	2022/12/15	475,916.0	12,990.28		0.0000%	2.7296%		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
共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>	20,000	2022/6/8	2022/6/22		3,950	3,950				
国庫短期証券買入	5,000	2022/6/8			22,167	5,000		0.011	0.013	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/6/7	2022/6/8	▲ 0.350	1,868	1,868		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/7	2022/6/8	▲ 0.350	0	0				
米ドル資金供給		2022/6/9	2022/6/16	1.080	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/6/8			934	934				

※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8日の予定

*1-3月期のGDP2次速報(市場予想:前期比年率▲1.0%)	*4月の米卸売売上高
*4月の国際収支	*1-3月期のユーロ圏GDP確報値
*5月の景気ウォッチャー調査	

◆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