Central Daily Market Report

2022年6月9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9日 需給速報	2022年6月10日 需給予想	2022年6月13日 当社予想
銀行券	▲ 700	100	1,000
財政	▲ 4,100	2,900	▲ 15,000
資金過不足	▲ 4,800	3,000	▲ 14,000

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	16,000		100			
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	▲ 3,000	1,700		3,000		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	9,700		6,100		▲ 14,000	

当座預金残高	5,390,300	5,396,400	5,382,400
準備預金残高	4,718,700		
積み終了先	4,718,700		
超過準備	4,718,700		
非準備預金先	671,600		

6月10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			3,871,700
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 80.65%

●2022年6月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、前日に比べやや上昇した水準で取引が行われた。立ち上がりは、邦銀・証券業態より▲0.06～▲0.025%近辺で出合いが見られた。一巡後は、▲0.065～▲0.02%近辺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、▲0.085～▲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>

9日はTB6M物（第1085回）の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかりと推移した。

<CP市場>

CP市場は、複数の入札が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。CP等買入オペは、応札8,201億、落札3,965億、按分レート▲0.001%、平均落札レート0.005%であった。

●短期金融市場関連指標

2022/6/9	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.029				－	▲ 0.087
T/N							－	▲ 0.086
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.036				－	▲ 0.089
2W							－	▲ 0.094
3W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.035				－	▲ 0.101
1M							－	▲ 0.107
3M							▲ 0.095	▲ 0.111
6M							▲ 0.096	▲ 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）
0.245	0.000	28,246.53	12.24	132.80-82	133.57-59

日付	6/2	6/3	6/6	6/7	6/8
日銀当預残	5,395,100	5,367,400	5,379,300	5,384,500	5,380,600
準備預金残	4,720,000	4,706,800	4,721,500	4,723,100	4,726,800
マネタリーベース	6,641,000	6,612,600	6,623,600	6,628,200	6,623,700
無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.039%	▲0.043%	▲0.045%	▲0.041%
コール市場残高	193,736	171,837	158,768	160,414	159,282
うち無担	164,028	142,132	128,504	130,747	129,663
うちO/N	80,965	64,889	52,041	53,564	52,770
うち有担	29,708	29,705	30,264	29,667	29,619

●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Ⅰ非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1085	－	28,000	2022/6/10	2022/12/12	111,088.0	22,648.5	100.0440	▲0.0867%	7.4513%	100.0480	▲0.0946%	5,351.0
流動性供給	359		5,000	2022/6/10		30,727.0	4,994.0		▲0.0030%	80.6374%		▲0.0060%	
エネルギー対策	－	－	8,000	2022/6/20	2023/6/20	218,956.0	7,999.96		0.0000%	3.7923%		0.0000%	

●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）		2022/6/9	2022/6/10	▲ 0.350	2,960	2,960		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/6/9	2022/6/10	▲ 0.350	0	0				
CP等買入	4,000	2022/6/14			8,201	3,965	▲0.001		0.005	53.8
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）		2022/6/10			60	60				

※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、0.005%。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10日の予定

*5月の企業物価指数
*5月の米財政収支
*5月の米消費者物価指数
*6月のミシガン大消費者信頼感指数速報
*国庫短期証券（1086回）入札
（3ヶ月、56,000億円、6/13発行）

◆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