

Central Daily Market Report

2022年6月10日(金)
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10日 需給速報	2022年6月13日 需給予想	2022年6月14日 当社予想			
銀行券	100	100	0			
財政	100	▲ 8,500	▲ 1,000			
資金過不足	200	▲ 8,400	▲ 1,000			
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	100	900				
CP等買入			▲ 400	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			▲ 300			
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						
国債補完供給	▲ 3,700	3,000	3,700			
※ドコモ資金供給用国債提供						
当増減	▲ 400	▲ 4,500	3,000			
当座預金残高	5,389,900	5,385,400	5,388,400			
準備預金残高	4,714,300					
積み終了先	4,714,200			6月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,714,200			積数	0	
非準備預金先	675,600			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	90.32%		

●2022年6月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日に向けた調整ニーズに加え、週末要因も重なった事で、各業態から積極的な資金調達が見られた。立ち上がりは、邦銀・証券業態より▲0.055~▲0.018%近辺の水準で調達が見られた。一巡後は、▲0.05~▲0.015%のレンジで散発的に出合いが見られた。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>

10日はTB3M物(第1086回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は、複数の入札が実施された。発行レートは、目線に変更はなく横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/6/10 単位：%	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.025				-	▲ 0.086	0.250	0.005	27,824.29	▲ 422.24	134.36-38	133.59-62		
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.086								
S/N							-	-								
1W							-	▲ 0.089								
2W							-	▲ 0.094								
3W							-	▲ 0.103								
1M			0.010				-	▲ 0.108								
3M							▲ 0.098	▲ 0.111								
6M							▲ 0.096	▲ 0.112								
1Y							▲ 0.110	▲ 0.112								
											日付	6/3	6/6	6/7	6/8	6/9
											日銀当預残	5,367,400	5,379,300	5,384,500	5,380,600	5,390,300
											準備預金残	4,706,800	4,721,500	4,723,100	4,726,800	4,718,700
											マネタリーベース	6,612,600	6,623,600	6,628,200	6,623,700	6,634,100
											無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.043%	▲ 0.045%	▲ 0.041%	▲ 0.029%
											コール市場残高	171,837	158,768	160,414	159,282	186,636
											うち無担	142,132	128,504	130,747	129,663	156,821
											うちO/N	64,889	52,041	53,564	52,770	79,728
											うち有担	29,705	30,264	29,667	29,619	29,815

●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	棄分率	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)
国庫短期証券	1086	-	56,000	2022/6/13	2022/9/12	173,957.0	45,289.30	100.0220	▲0.0882%	54.5268%	100.0235	▲0.0942%	10,710.0

●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	申込総額(億円・百万ドル)	着札総額(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	平均着札レート・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)		2022/6/10	2022/6/13	▲ 0.350	3,709	3,709		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/10	2022/6/13	▲ 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)※		2022/6/13			880	880				

※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13日の予定

*4-6月期の法人企業景気予測調査季報

◆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