

Central Daily Market Report

2022年6月13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13日 需給速報	2022年6月14日 需給予想	2022年6月15日 当社予想
銀行券	100	▲ 200	▲ 1,000
財政	▲ 9,800	6,400	67,000
資金過不足	▲ 9,700	6,200	66,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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	900	15,200	
CP等買入		▲ 400	▲ 400
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			
E T F 買入		700	
国債補完供給	▲ 4,000	3,700	4,000
※FOMC資金供給用国債提供			
当増減	▲ 9,800	29,700	66,000
当座預金残高	5,380,100	5,409,800	5,475,800
準備預金残高	4,741,500		
積み残高	4,741,500		6月14日以降の残り所要積立額
超過準備	4,741,500		積数
非準備預金先	638,600		1日平均
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
			93.55%

●2022年6月13日の市場動向

＜インターバンク市場＞

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落した事で、前営業日比やや低下となった。立ち上がりは邦銀・証券業態より▲0.035~▲0.025%の水準で調達が見られた。一巡後も大きな変化は無く、同水準での推移となった。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＞

13日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は、五・十日発行にあたり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

2022/6/13	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.085	0.250	0.000	26,987.44	▲ 836.85	134.77-79	134.59-60
T/N							-	▲ 0.085						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.035				-	▲ 0.090						
2W	0.010	0.100	0.045				-	▲ 0.094						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.108						
3M			0.040				▲ 0.099	▲ 0.112						
6M							▲ 0.096	▲ 0.111						
1Y							▲ 0.101	▲ 0.111						
									日付	6/6	6/7	6/8	6/9	6/10
									日銀当預残	5,379,300	5,384,500	5,380,600	5,390,300	5,389,900
									準備預金残	4,721,500	4,723,100	4,726,800	4,718,700	4,714,100
									マネタリーベース	6,623,600	6,628,200	6,623,700	6,634,100	6,633,600
									無担O/N加重平均	▲0.043%	▲0.045%	▲0.041%	▲0.029%	▲0.025%
									コール市場残高	158,768	160,414	159,282	186,636	183,608
									うち無担	128,504	130,747	129,663	156,821	152,855
									うちO/N	52,041	53,564	52,770	79,728	77,912
									うち有担	30,264	29,667	29,619	29,815	30,753

●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1非価格競争入札(億円)	第1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)	簿札総額(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	平均簿札レート・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)		2022/6/13	2022/6/14	▲ 0.350	3,960	3,960		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/13	2022/6/14	▲ 0.350	71	71		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※		2022/6/14			15,337	15,337				

※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、0.000%。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14日の予定

*米FOMC(1日目)	*国庫短期証券(1087回)
*5月の米生産者物価指数	(6ヶ月、28,000億円、6/16発行)
	*流動性供給入札
	(5,000億円、6/15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り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