Central Daily Market Report

2022年6月14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14日 需給速報	2022年6月15日 需給予想	2022年6月16日 当社予想
銀行券	▲ 200	▲ 400	▲ 1,000
財政	3,800	72,100	8,000
資金過不足	3,600	71,700	7,000

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	15,200		31,800			
CP等買入	4,000	▲ 400		▲ 500		
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	700					
国債補完供給	▲ 4,700	4,000		4,700		
米ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	22,400		107,600		7,000	

当座預金残高	5,402,500	5,510,100	5,517,100
準備預金残高	4,735,000		
積み終了先	4,735,000		
超過準備	4,735,000		
非準備預金先	667,500		

6月15日以降の残り所要積立額	
積数	0
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 96.77%

●2022年6月14日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、概ね前日と同水準での取引となった。立ち上がりは邦銀・証券業態より▲0.04～▲0.03%近辺で調達が見られた。一巡後はやや取り上がる展開も見られ、▲0.035～▲0.025%程度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、▲0.095～▲0.085%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>

14日はTB6M物（第1087回）の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。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

2022/6/14	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	▲ 0.034				－	▲ 0.087
T/N							－	▲ 0.091
S/N							－	－
1W	▲ 0.030	▲ 0.020	▲ 0.029				－	▲ 0.094
2W	▲ 0.045	0.045	▲ 0.023				－	▲ 0.097
3W							－	▲ 0.104
1M							－	▲ 0.109
3M							▲ 0.100	▲ 0.111
6M							▲ 0.100	▲ 0.111
1Y							▲ 0.100	▲ 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）
0.250	0.000	26,629.86	▲ 357.58	134.21-23	134.42-44

日付	6/7	6/8	6/9	6/10	6/13
日銀当預残	5,384,500	5,380,600	5,390,300	5,389,900	5,380,100
準備預金残	4,723,100	4,726,800	4,718,700	4,714,100	4,741,500
マネタリーベース	6,628,200	6,623,700	6,634,100	6,633,600	6,623,700
無担O/N加重平均	▲0.045%	▲0.041%	▲0.029%	▲0.025%	▲0.033%
コール市場残高	160,414	159,282	186,636	183,608	166,915
うち無担	130,747	129,663	156,821	152,855	136,378
うちO/N	53,564	52,770	79,728	77,912	62,505
うち有担	29,667	29,619	29,815	30,753	30,537

●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	1087	－	28,000	2022/6/16	2022/12/16	88,831.0	22,648.4	100.0450	▲0.0897%	3.6740%	100.0500	▲0.0996%	5,351.0
流動性供給	360		5,000	2022/6/15		9,747.0	4,993.00		0.0990%	13.5446%		0.0840%	

●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
国債買入（残存期間5年超10年以下）	8,000	2022/6/15			8,116	8,000	▲0.029		0.029	68.0
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,000	2022/6/15			3,429	1,001	0.015		0.025	100.0
国債買入（残存期間25年超）	500	2022/6/15			1,438	502	0.005		0.021	92.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/6/14	2022/6/15	▲ 0.350	3,612	3,612		▲0.350	▲0.352	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/6/14	2022/6/15	▲ 0.350	1,151	1,151		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2022/6/16	2022/6/23	1.680	1	1				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※		2022/6/15			22,126	22,126				
米ドル資金供給用担保国債供給（国債売現先）	5,000	2022/6/15	2022/6/24		2	2		▲0.100	▲0.100	

※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15日の予定

*4月の機械受注統計
（市場予想：電力除く民需、前月比▲1.5%）
*4月の第3次産業活動指数
*米FOMC（2日目）
*FRB 米経済見通し発表
*5月の米小売売上高
*4月の米企業在庫
*国庫短期証券（1088回）入札
（1年、35,000億円、6/20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