Central Daily Market Report

2022年6月16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16日 需給速報	2022年6月17日 需給予想	2022年6月20日 当社予想
銀行券	▲ 900	▲ 600	▲ 1,000
財政	▲ 1,900	11,100	80,000
資金過不足	▲ 2,800	10,500	79,000

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	37,200		7,300			
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						▲ 17,600
被災地支援						
社債等買入				▲ 300		
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	▲ 32,200	16,000		32,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減		18,000		49,600		61,400

当座預金残高	5,511,200	5,560,800	5,622,200
準備預金残高	4,846,200		
積み終了先	3,497,600	6月17日以降の残り所要積立額	
超過準備	1,471,600	積数	369,200
非準備預金先	665,000	1日平均	12,700
積み期間（6/16～7/15）の所要準備額			3,743,800
準備預金進捗率	実績 90.14%	日数	3.33%

●2022年6月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新しい積み期間となりレート水準は低下となった。立ち上がりは邦銀・証券業態より▲0.05～▲0.04%近辺で調達が見られた。一巡後は小幅に上昇し、▲0.045～▲0.035%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、▲0.10～▲0.15%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>

16日はTB3M物（第1089回）の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、強含んで推移した。この他、1Y、6M物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2022/6/16	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.042				－	▲ 0.102
T/N			▲ 0.029				－	▲ 0.151
S/N							－	－
1W	▲ 0.040	0.010	▲ 0.034				－	▲ 0.148
2W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.032				－	▲ 0.153
3W							－	▲ 0.151
1M	▲ 0.035	0.005	▲ 0.027				－	▲ 0.149
3M							▲ 0.180	▲ 0.123
6M							▲ 0.130	▲ 0.117
1Y							▲ 0.130	▲ 0.115

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	26,431.20	105.04	134.05-06	134.22-24

日付	6/9	6/10	6/13	6/14	6/15
日銀当預残	5,390,300	5,389,900	5,380,100	5,402,500	5,493,200
準備預金残	4,718,700	4,714,100	4,741,500	4,735,000	4,825,800
マネタリーベース	6,634,100	6,633,600	6,623,700	6,646,200	6,737,400
無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.025%	▲0.033%	▲0.034%	▲0.023%
コール市場残高	186,636	183,608	166,915	159,710	168,793
うち無担	156,821	152,855	136,378	129,182	139,011
うちO/N	79,728	77,912	62,505	57,314	67,893
うち有担	29,815	30,753	30,537	30,528	29,782

●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	1089	－	56,000	2022/6/20	2022/9/20	160,149.0	45,289.8	100.0330	▲0.1308%	36.3204%	100.0373	▲0.1479%	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	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）		2022/6/16	2022/6/17	▲ 0.350	30,998	30,998		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/6/16	2022/6/17	▲ 0.350	1,281	1,281		▲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）※1		2022/6/17			6,805	6,805				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※2		2022/6/17			533	533				

※1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。

※2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356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。

種類		スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額（億円）
貸出増加支援オペ	貸付期間4年（新規貸付）	2022/6/20	2026/6/20	0	46,265

●2022年6月17日の予定

*日銀政策委・金融政策決定会合（2日目、終了後直ちに結果公表）
*黒田日銀総裁定例会見
*4月の石油等消費動態統計
*5月の米鉱工業生産・設備稼働率
*5月のユーロ圏消費者物価指数改定値

◆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