

Central Daily Market Report

2022年6月17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17日 需給速報	2022年6月20日 需給予想	2022年6月21日 当社予想	
銀行券	▲ 600	100	▲ 1,000	
財政	9,800	69,800	3,000	
資金過不足	9,200	69,900	2,000	
金融調節	スタート	スタート	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	7,300	17,500		
CP等買入		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)		46,300	▲ 12,300	
被災地支援				
社債等買入		▲ 300	▲ 600	
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				
国債補充供給	▲ 26,500	32,200	26,500	
※メドバンク債供給開始				
当増増減	21,800	147,200	2,000	
当座預金残高	5,533,000	5,680,200	5,682,200	
準備預金残高	4,873,700			
積み終了先	4,868,200	6月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,753,800	積数	9,500	
非準備預金先	659,300	1日平均	400	
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	99.75%	日数	13.33%

●2022年6月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因により調達レートを引き上げる先も見られたが、様子見姿勢の参加者も多く、全体的には昨日と横ばい圏内で取引が行われた。立ち上がりは、邦銀・証券業態等より▲0.055~▲0.025%近辺で調達が見られた。一巡後は、▲0.055~▲0.02%近辺のレンジで散発的な出合いが見られた。
ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。
本日の日銀金融政策決定会合では、現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.09%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>

17日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物と3M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は、大型を含めて複数の入札が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●入札結果

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。

●2022年6月20日の予定

*月例経済報告

●短期金融市場関連指標

2022/6/17	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		
	単位:%	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.040					-	▲ 0.143	0.220	▲ 0.030	25,963.00	▲ 468.20	132.39-43	134.27-31
T/N			▲ 0.028					-	▲ 0.162						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.156						
2W								-	▲ 0.164						
3W								-	▲ 0.156						
1M	▲ 0.038	▲ 0.035	▲ 0.037					-	▲ 0.154						
3M								▲ 0.200	▲ 0.131						
6M								▲ 0.134	▲ 0.124						
1Y								▲ 0.130	▲ 0.118						
									日付		6/10	6/13	6/14	6/15	6/16
									日銀当預残	5,389,900	5,380,100	5,402,500	5,493,200	5,511,200	
									準備預金残	4,714,100	4,741,500	4,735,000	4,825,800	4,847,400	
									マネタリーベース	6,633,600	6,623,700	6,646,200	6,737,400	6,756,300	
									無担O/N加重平均	▲ 0.025%	▲ 0.033%	▲ 0.034%	▲ 0.023%	▲ 0.042%	
									コール市場残高	183,608	166,915	159,710	168,793	168,500	
									うち無担	152,855	136,378	129,182	139,011	138,634	
									うちO/N	77,912	62,505	57,314	67,893	68,041	
									うち有担	30,753	30,537	30,528	29,782	29,866	

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/6/17	2022/6/20	▲ 0.450	22,821	22,821		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/17	2022/6/20	▲ 0.450	3,675	3,675		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/6/20			17,349	17,349				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/6/20			250	250				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2022/6/20			0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※4		2022/6/20			0	0				

※1原簿買入(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回の買入利率は、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※2原簿買入(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356回の買入利率は、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※3原簿買入(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回の買入利率は、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※4原簿買入(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356回の買入利率は、0.250%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について
1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。
(1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(賛成8反対1)
① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。
短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けなければならない金額の長期国債の買入れを行う。
② 連続指値オペの運用
上記の金融市場調節方針を実現するため、10年物国債金利について0.25%の利回りで指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。
(2) 資産買入れ方針(全員一致)
長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
① E T F および J - R E I T について、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
② C P 等、社債等については、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(C P 等: 約2兆円、社債等: 約3兆円)へと徐々に戻していく。

◆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