

# Central Daily Market Report

2022年6月22日(水)  
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22日 需給速報	2022年6月23日 需給予想	2022年6月24日 当社予想
銀行券	▲ 800	▲ 1,600	▲ 2,000
財政	▲ 26,600	▲ 1,200	3,000
資金過不足	▲ 27,400	▲ 2,800	1,000
<b>金融調節</b>			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	4,500	▲ 4,000	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		10,300	
CP等買入		▲ 300	▲ 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	▲ 28,000	29,700	28,000
※ドル資金供給用国債国債供給			
当増減	▲ 25,600	35,000	1,000
当座預金残高	5,624,400	5,659,400	5,660,400
準備預金残高	4,948,100		
積み終了先	4,947,500		6月23日以降の残り所要積立額
超過準備	4,947,400		積数
非準備預金先	676,300		1日平均
			200
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	99.90%	日数
			23.33%

## ●2022年6月22日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.06~▲0.025%近辺の水準で出合いで始まった。一巡後は▲0.075~▲0.025%にやや低下して出合いが見られ、本日の取引を終えた。  
ターム物は、ショートターム物の引き合いが散見された程度であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.10%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>

22日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP市場は大型を含めて複数の入札が実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2022/6/22	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.113	0.235	0.001	26,149.55	▲ 96.76	136.31-34	136.23-25	
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.114							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.050	▲ 0.025	▲ 0.041				-	▲ 0.129							
2W							-	▲ 0.147							
3W							-	▲ 0.147							
1M	▲ 0.040	▲ 0.013	▲ 0.033				-	▲ 0.145							
3M							▲ 0.200	▲ 0.131							
6M							▲ 0.135	▲ 0.125							
1Y							▲ 0.130	▲ 0.120							
									日付		6/15	6/16	6/17	6/20	6/21
									日銀当預残	5,493,200	5,511,200	5,533,000	5,643,600	5,650,000	
									準備預金残	4,825,800	4,847,400	4,876,200	4,960,900	4,964,500	
									マネタリーベース	6,737,400	6,756,300	6,778,700	6,889,200	6,896,100	
									無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.042%	▲0.040%	▲0.044%	▲0.046%	
									コール市場残高	168,793	168,500	177,027	169,407	167,109	
									うち無担	139,011	138,634	147,246	143,721	141,621	
									うちO/N	67,893	68,041	74,083	68,658	65,563	
									うち有担	29,782	29,866	29,781	25,686	25,488	

## ●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	募入最高利回り	案分率	募入平均価格	募入平均利回り	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	オフア額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率	応募総額(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1年超3年以下)	4,750	2022/6/23			12,988	4,755	▲0.016		▲0.016	87.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/6/23			8,993	5,002	▲0.006		▲0.002	86.8
国債買入(残存期間25年超)	500	2022/6/23			2,481	505	0.002		0.003	33.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2022/6/22	2022/6/23	-0.35	27,212	27,212		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/6/22	2022/6/23	-0.35	790	790		▲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		2022/6/23			0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/6/23			0	0				
社債等買入	1,000	2022/6/27			2,026	1,000	0.196		0.218	47.5

※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、0.005%。この結果、10年利付国債364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ア。

※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、0.016%。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ア。

## ●2022年6月23日の予定

*20年利付国債入札 (12,000億円、6/24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