

# Central Daily Market Report

2022年6月23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23日 需給速報	2022年6月24日 需給予想	2022年6月27日 当社予想
銀行券	▲ 1,600	▲ 600	0
財政	▲ 3,300	3,100	▲ 11,000
資金過不足	▲ 4,900	2,500	▲ 11,000
<b>金融調節</b>			
	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	10,300		
CP等買入		▲ 500	▲ 700
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 400
ETF買入			1,000
国債補充供給	▲ 31,900	28,000	31,900
当預増減	1,000	33,300	▲ 10,000
当座預金残高	5,625,400	5,658,700	5,648,700
準備預金残高	4,954,500		
積み終了先	4,954,100		6月24日以降の残り所要積立額
超過準備	4,954,000		積数
非準備預金先	670,900		1日平均
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	99.91%	日数
			26.67%

## ●2022年6月23日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、昨日とほぼ横ばいの水準での取引となった。立ち上がりは国内勢を中心に、▲0.055~▲0.025%近辺の出会い。一巡後は▲0.075~▲0.025%近辺の水準での調達が見られた。ターム物は、目立った出会いは見られなかった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲0.10%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>

23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

2022/6/23 単位：%	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		
	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	▲ 0.079	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.135	0.230	▲ 0.005	26,171.25	21.70	135.98-00	135.37-38	
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.191							
S/N							-	-							
1W	▲ 0.055	0.010	▲ 0.043				-	▲ 0.193							
2W							-	▲ 0.184							
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.173							
1M							-	▲ 0.169							
3M							▲ 0.200	▲ 0.143							
6M							▲ 0.140	▲ 0.134							
1Y							▲ 0.130	▲ 0.127							
									日付		6/16	6/17	6/20	6/21	6/22
									日銀当預残	5,511,200	5,533,000	5,643,600	5,650,000	5,624,400	
									準備預金残	4,847,400	4,876,200	4,960,900	4,964,500	4,946,400	
									マネタリーベース	6,756,300	6,778,700	6,889,200	6,896,100	6,871,200	
									無担O/N加重平均	▲0.042%	▲0.040%	▲0.044%	▲0.046%	▲0.047%	
									コール市場残高	168,500	177,027	169,407	167,109	171,011	
									うち無担	138,634	147,246	143,721	141,621	141,894	
									うちO/N	68,041	74,083	68,658	65,563	64,256	
									うち有担	29,866	29,781	25,686	25,488	29,117	

## ●入札結果

名称	回数	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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
20年利付国債	180	0.800%	12,000	2022/6/24	2042/3/20	32,817.0	9,705.00	98,1000	0.9130%	42.0370%	98.2300	0.9050%	2,289.0

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/6/23	2022/6/24	▲ 0.350	30,828	30,828		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/23	2022/6/24	▲ 0.350	967	967		▲ 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		2022/6/24			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		2022/6/24			0	0				

※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、0.011%。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。

## ●2022年6月24日の予定

*全国信用金庫大会において雨宮副総裁講演	*5月の米新築一戸建て販売件数	*国庫短期証券(1090回)入札(3ヶ月、56,000億円、6/27発行)
*5月の全国消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.1%)		
*5月の企業向けサービス価格指数		

◆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。

◆本資料は向から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等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