

Central Daily Market Report

2022年6月30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30日 需給速報	2022年7月1日 需給予想	2022年7月4日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 200	500			
財政	5,500	▲ 16,100	▲ 34,000			
資金過不足	4,600	▲ 16,300	▲ 33,500			
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	12,100					
CP等買入	4,000	▲ 4,800				
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	▲ 32,300	18,700	32,300			
※本日の資金需給速報は国債買入を除く						
当増減	2,300	15,900	▲ 33,500			
当座預金残高	5,523,100	5,539,000	5,505,500			
準備預金残高	4,856,400					
積み終了先	4,855,900			7月1日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,855,900			積数	300	
非準備預金先	666,700			1日平均	0	
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	99.99%	日数	50.00%		

●2022年6月30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▲0.055~▲0.02%の調達で始まった。四半期末の取引となり、一部で調達を見送る先も見られたことから、レート水準は前日比で低下した。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、今月の取引を終えた。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.12%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>

30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発行市場は複数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

2022/6/30	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.040					-	▲ 0.233	0.225	0.000	26,393.04	▲ 411.56	136.60-62	136.19-21	
T/N			▲ 0.020					-	▲ 0.139							
S/N								-	-							
1W	▲ 0.043	0.010	▲ 0.021					-	▲ 0.139							
2W	▲ 0.038	▲ 0.014	▲ 0.031					-	▲ 0.141							
3W								-	▲ 0.137							
1M	▲ 0.030	0.100	▲ 0.016					-	▲ 0.136							
3M								▲ 0.145	▲ 0.136							
6M								▲ 0.135	▲ 0.131							
1Y								▲ 0.125	▲ 0.128							
										日付		6/23	6/24	6/27	6/28	6/29
										日銀当預残	5,625,400	5,632,500	5,634,300	5,523,300	5,520,800	
										準備預金残	4,954,500	4,955,300	4,959,800	4,860,000	4,848,500	
										マネタリーベース	6,873,800	6,881,600	6,883,600	6,772,900	6,771,000	
										無担O/N加重平均	▲0.047%	▲0.040%	▲0.040%	▲0.039%	▲0.033%	
										コール市場残高	164,708	169,181	163,462	163,611	163,449	
										うち無担	138,575	140,165	134,522	133,677	135,062	
										うちO/N	60,597	61,877	56,464	55,739	58,287	
										うち有担	26,133	29,016	28,940	29,934	28,387	

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	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	オフー額(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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/6/30	2022/7/1	▲0.550	32,248	32,248		▲0.550	▲0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/30	2022/7/1	▲0.550	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/7/1			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		2022/7/1			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、0.065%。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7月1日の予定

*6月調査の日銀短観(概要及び要旨) (市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI)+13)	*5月の米建設支出	*国庫短期証券(1091回) (3ヶ月、56,000億円、7/4発行)
*5月の完全失業率(市場予想:+2.5%)	*6月のISM 製造業景況指数	
*6月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.1%)	*6月のユーロ圏消費者物価指数速報値	
*5月の有効求人倍率(市場予想:+1.24倍)		

◆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