Central Daily Market Report

2022年6月3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3日 需給速報	2022年6月6日 需給予想	2022年6月7日 当社予想
銀行券	600	800	1,000
財政	▲ 27,000	▲ 1,300	4,500
資金過不足	▲ 26,400	▲ 500	5,500

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			11,500			
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
貸出支援基金（成）	3,200	▲ 4,500				
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 100		
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	▲ 1,200	1,500		1,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 27,700		12,000		5,500	

当座預金残高	5,367,400	5,379,400	5,384,900
準備預金残高	4,706,800		
積み終了先	4,706,800		
超過準備	4,706,800		
非準備預金先	660,600		

6月6日以降の残り所要積立額	
積数	100
1日平均	0

積み期間（5/16～6/15）の所要準備額			3,873,000
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数 67.74%

●2022年6月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.05～▲0.035%での調達で始まった。週末は、レートが上昇しやすい傾向にあるが、昨日までの流れを引き継ぎ小幅低下する展開となった。一巡後は▲0.06～▲0.04%での調達が見られ本日の取引を終了した。ターム物は目立った出合いが見られなかった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.090～▲0.080%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>

3日はTB3M物（第1084回）の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底型く推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部でまとまった発行も見られたが、案件は少なかった。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2022/6/3	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.039				－	▲ 0.087
T/N			▲ 0.015				－	▲ 0.085
S/N			▲ 0.005				－	－
1W	▲ 0.035	0.000	▲ 0.028				－	▲ 0.092
2W	▲ 0.030	▲ 0.007	▲ 0.023				－	▲ 0.098
3W							－	▲ 0.105
1M							－	▲ 0.112
3M							▲ 0.093	▲ 0.113
6M							▲ 0.110	▲ 0.112
1Y							▲ 0.110	▲ 0.112

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）
0.230	▲ 0.010	27,761.57	347.69	129.94-95	129.88-90

日付	5/27	5/30	5/31	6/1	6/2
日銀当預残	5,500,000	5,477,100	5,487,900	5,435,500	5,395,100
準備預金残	4,821,800	4,801,500	4,811,100	4,757,900	4,720,000
マネタリーベース	6,747,300	6,723,900	6,734,000	6,681,200	6,641,000
無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.022%	▲0.026%	▲0.029%	▲0.034%
コール市場残高	239,417	220,542	186,453	195,131	193,736
うち無担	208,619	189,356	157,993	165,589	164,028
うちO/N	116,926	99,063	70,790	84,736	80,965
うち有担	30,798	31,186	28,460	29,542	29,708

●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	1084	－	59,000	2022/6/6	2022/9/5	127,826.0	47,713.3	100.0220	▲0.0882%	44.8892%	100.0237	▲0.0950%	11,286.0

●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
国債買入（残存期間1年以下）	1,500	2022/6/6			6,185	1,506	0.005		0.018	41.9
国債買入（残存期間1年超3年以下）	4,750	2022/6/6			11,761	4,756	▲0.003		▲0.002	51.5
国債買入（残存期間3年超5年以下）	4,750	2022/6/6			10,619	4,756	▲0.003		▲0.002	15.5
国債買入（残存期間25年超）	500	2022/6/6			1,614	502	0.007		0.007	91.1
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/6/3	2022/6/6	▲ 0.350	1,196	1,196		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/6/3	2022/6/6	▲ 0.350	0	0				
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※		2022/6/6			0	0				

※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、0.010%。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。

●2022年6月6日の予定

*特にありません

◆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