

Central Daily Market Report

2022年6月8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8日 需給速報	2022年6月9日 需給予想	2022年6月10日 当社予想			
銀行券	500	▲ 800	▲ 1,000			
財政	▲ 9,000	▲ 3,900	7,000			
資金過不足	▲ 8,500	▲ 4,700	6,000			
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	4,000	▲ 5,300				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	5,000					
国債買入	900		16,000			
CP等買入		▲ 200	▲ 100			
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 感染症対策支援特別						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 1,700	1,900	1,700			
※本日の資金需給速報は国債買入						
当増減	▲ 3,900		12,800			6,000
当座預金残高	5,380,600		5,393,400			5,399,400
準備預金残高	4,726,800					
積み終了先	4,726,800			6月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,726,800			積数		100
非準備預金先	653,800			1日平均		0
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額						3,871,700
準備預金進捗率	実績	100.00%		日数		77.42%

●2022年6月8日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に一部で積極的な資金調達ニーズが見られたことから、昨日よりやや高い水準で取引が行われた。立ち上がりは、▲0.065~▲0.035%近辺で出合いが見られた。一巡後は、▲0.06~▲0.03%と出合いレンジが若干上昇した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲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>

8日のアウトライ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、0%近傍と概ね変わらないものの、銘柄により若干の強弱があった。

●短期金融市場関連指標

2022/6/8 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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.041				-	▲ 0.086	0.245	0.000	28,234.29	290.34	132.80-82	133.57-59	
T/N	▲ 0.048	▲ 0.009	▲ 0.037				-	▲ 0.086							
S/N			▲ 0.005				-	-							
1W			0.000				-	▲ 0.089							
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.094							
3W			▲ 0.033				-	▲ 0.100							
1M							-	▲ 0.107							
3M							▲ 0.093	▲ 0.111							
6M							▲ 0.110	▲ 0.112							
1Y							▲ 0.110	▲ 0.112							
									日付		6/1	6/2	6/3	6/6	6/7
									日銀当預残	5,435,500	5,395,100	5,367,400	5,379,300	5,384,500	
									準備預金残	4,757,900	4,720,000	4,706,800	4,721,500	4,723,100	
									マネタリーベース	6,681,200	6,641,000	6,612,600	6,623,600	6,628,200	
									無担O/N加重平均	▲ 0.029%	▲ 0.034%	▲ 0.039%	▲ 0.043%	▲ 0.045%	
									コール市場残高	195,131	193,736	171,837	158,768	160,414	
									うち無担	165,589	164,028	142,132	128,504	130,747	
									うちO/N	84,736	80,965	64,889	52,041	53,564	
									うち有担	29,542	29,708	29,705	30,264	29,667	

●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。

●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年超3年以下)	4,750	2022/6/9			12,207	4,756	▲0.002		▲0.001	73.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,750	2022/6/9			9,406	4,755	▲0.010		▲0.008	10.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2022/6/9			11,162	5,004	▲0.006		▲0.005	59.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,250	2022/6/9			3,738	1,256	▲0.005		▲0.004	81.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)		2022/6/8	2022/6/9	▲ 0.350	1,661	1,661		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)		2022/6/8	2022/6/9	▲ 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)※		2022/6/9			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、0.005%。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ー。

●2022年6月9日の予定

*5月のマネーストック

*4月の特定サービス産業動態統計速報

*ECB定例理事会(金融政策発表)

*国庫短期証券(1085回)

(6ヶ月、28,000億円、6/10発行)

*流動性供給入札

(5,000億円、6/10発行)

*エネルギー対策借入

(8,000億円、6/20借入)

◆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