

Central Daily Market Report

2022年6月21日(火)
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21日 需給速報	2022年6月22日 需給予想	2022年6月23日 当社予想
銀行券	▲ 500	▲ 800	▲ 1,000
財政	3,300	▲ 27,200	2,000
資金過不足	2,800	▲ 28,000	1,000
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
			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	1,000		
国債買入			
CP等買入	▲ 400	▲ 300	
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	▲ 29,700	32,700	29,700
※ドル資金供給用国債供給			
当増減	6,400	1,800	1,000
当座預金残高	5,650,000	5,651,800	5,652,800
準備預金残高	4,964,500		
積み終了先	4,963,400		
超過準備	4,963,300		
非準備預金先	685,500		
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	99.89%	日数
			20.00%

●2022年6月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢より▲0.06~▲0.025%近辺の出合いで始まった。全般的に調達水準を引き下げる動きが見られ、昨日対比で出合いレートは低下した。一巡後は、▲0.08~▲0.02%台での出合いが中心となった。ターム物は四半期末を控え、閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.11~▲0.09%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>

21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市場は多くの業態から入札が実施され、一部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

2022/6/21	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)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.046				-	▲ 0.137	0.234	0.004	26,246.31	475.09	135.09-11	135.22-23
T/N			▲ 0.030				-	▲ 0.110						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.038	0.280	▲ 0.012				-	▲ 0.131						
2W							-	▲ 0.140						
3W							-	▲ 0.141						
1M	▲ 0.040	▲ 0.025	▲ 0.036				-	▲ 0.142						
3M							▲ 0.200	▲ 0.130						
6M							▲ 0.135	▲ 0.123						
1Y							▲ 0.130	▲ 0.118						
日付		6/14	6/15	6/16	6/17	6/20								
日銀当預残		5,402,500	5,493,200	5,511,200	5,533,000	5,643,600								
準備預金残		4,735,000	4,825,800	4,847,400	4,876,200	4,960,900								
マネタリーベース		6,646,200	6,737,400	6,756,300	6,778,700	6,889,200								
無担O/N加重平均		▲0.034%	▲0.023%	▲0.042%	▲0.040%	▲0.044%								
コール市場残高		159,710	168,793	168,500	177,027	169,407								
うち無担		129,182	139,011	138,634	147,246	143,721								
うちO/N		57,314	67,893	68,041	74,083	68,658								
うち有担		30,528	29,782	29,866	29,781	25,686								

●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)
5年利付国債	152	0.100%	25,000	2022/6/22	2027/3/20	63,963.0	20,207.00	100.0500	0.0890%	70.9981%	100.0800	0.0830%	4,784.0

●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
共通担保資金供給(全店) <固定金利方式>	20,000	2022/6/22	2022/7/6		4,450	4,450				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/6/21	2022/6/22	-0.35	28,975	28,975		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/21	2022/6/22	-0.35	700	700		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2022/6/23	2022/6/30	1.84	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		2022/6/22			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		2022/6/22			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、0.011%。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、0.020%。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22日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(4月27、28日分)	*5月の英消費者物価指数
--------------------------	--------------

◆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