Central Daily Market Report

2022年6月24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24日 需給速報	2022年6月27日 需給予想	2022年6月28日 当社予想
銀行券	▲ 700	▲ 300	▲ 1,000
財政	▲ 200	▲ 3,800	2,000
資金過不足	▲ 900	▲ 4,100	1,000

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 700		▲ 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		▲ 400	1,000			
新型コロナ対応金融支援特別						▲ 124,700
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 22,800	31,900		22,800		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減		7,100		19,600		▲ 123,700

当座預金残高	5,632,500	5,652,100	5,528,400
準備預金残高	4,955,300		
積み終了先	4,954,900		
超過準備	4,954,900		
非準備預金先	677,200		

6月27日以降の残り所要積立額	
積数	2,000
1日平均	100

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	99.95%	日数 36.67%

●2022年6月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、全般的に取り上がる動きが見られ、前日対比でレート上昇となった。立ち上がりは、国内勢より▲0.05～▲0.025%近辺の出合い。一巡後は▲0.075～▲0.025%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、▲0.12～▲0.08%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>

24日はTB3M物（第1090回）の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかりと推移した。

<CP市場>

CP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

2022/6/24	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.040				－	▲ 0.100
T/N			▲ 0.028				－	▲ 0.108
S/N							－	－
1W							－	▲ 0.182
2W							－	▲ 0.165
3W							－	▲ 0.158
1M							－	▲ 0.154
3M							▲ 0.178	▲ 0.144
6M							▲ 0.140	▲ 0.135
1Y							▲ 0.130	▲ 0.127

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）
0.221	▲ 0.009	26,491.97	320.72	134.81-83	134.53-55

日付	6/17	6/20	6/21	6/22	6/23
日銀当預残	5,533,000	5,643,600	5,650,000	5,624,400	5,625,400
準備預金残	4,876,200	4,960,900	4,964,500	4,946,400	4,954,500
マネタリーベース	6,778,700	6,889,200	6,896,100	6,871,200	6,873,800
無担O/N加重平均	▲0.040%	▲0.044%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%
コール市場残高	177,027	169,407	167,109	171,011	164,708
うち無担	147,246	143,721	141,621	141,894	138,575
うちO/N	74,083	68,658	65,563	64,256	60,597
うち有担	29,781	25,686	25,488	29,117	26,133

●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	1090	－	56,000	2022/6/27	2022/9/26	129,764.0	45,289.90	100.0360	▲0.1443%	27.7161%	100.0458	▲0.1836%	10,710.0

●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
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2022/6/24	2022/6/27	▲ 0.450	22,185	22,185		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2022/6/24	2022/6/27	▲ 0.450	650	650		▲0.450	▲0.450	
国債買入（固定利回り方式）（残存期間5年超10年以下）※1		2022/6/27			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		2022/6/27			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、0.040%。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27日の予定

*1-3月期の資金循環統計速報
*4月の景気動向指数改訂状況
*決定会合における主な意見（6月16・17日分）
*5月の米耐久財新規受注

◆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