

Central Daily Market Report

2022年6月27日(月)
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27日 需給速報	2022年6月28日 需給予想	2022年6月29日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 300	▲ 1,000
財政	▲ 1,400	700	3,500
資金過不足	▲ 1,700	400	2,500
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
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	▲ 100	▲ 500	
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	1,000		
新型コロナウイルス対応金融支援特別		11,900	▲ 124,700
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補充供給	▲ 20,200	22,800	20,200
※ドル資金需給速報用別添資料			
当増増減	1,800	▲ 92,700	2,500
当座預金残高	5,634,300	5,541,600	5,544,100
準備預金残高	4,960,100		
積み終了先	4,959,700		6月28日以降の残り所要積立額
超過準備	4,959,700		積数
非準備預金先	674,200		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	99.96%	日数
			40.00%

●2022年6月27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~▲0.025%程度と、前営業日比横ばい水準での調達で始まった。一巡後も朝方と同水準の出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物は、目立った出合いはなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲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>

27日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<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。本日CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオフアされた。結果は平均落札レート0.009%、按分レート▲0.001%と前回比(平均0.005%・按分▲0.001%)で平均は上昇し、按分は横ばいで推移した。

●短期金融市場関連指標

2022/6/27	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.075	0.001	▲ 0.040				-	▲ 0.087	0.230	0.009	26,871.27	379.30	135.04-06	135.06-09	
T/N			▲ 0.027				-	▲ 0.090							
S/N							-	-							
1W							-	▲ 0.167							
2W							-	▲ 0.154							
3W			0.005				-	▲ 0.153							
1M							-	▲ 0.147							
3M	0.020	0.045	0.022				▲ 0.167	▲ 0.142							
6M							▲ 0.140	▲ 0.134							
1Y							▲ 0.130	▲ 0.130							
										日付	6/20	6/21	6/22	6/23	6/24
										日銀当預残	5,643,600	5,650,000	5,624,400	5,625,400	5,632,500
										準備預金残	4,960,900	4,964,500	4,946,400	4,954,500	4,955,300
										マネタリーベース	6,889,200	6,896,100	6,871,200	6,873,800	6,881,600
										無担O/N加重平均	▲0.044%	▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.040%
										コール市場残高	169,407	167,109	171,011	164,708	169,181
										うち無担	143,721	141,621	141,894	138,575	140,165
										うちO/N	68,658	65,563	64,256	60,597	61,877
										うち有担	25,686	25,488	29,117	26,133	29,016

●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	オフア額 (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(午前オフア分)		2022/6/27	2022/6/28	▲ 0.350	19,057	19,057		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2022/6/27	2022/6/28	▲ 0.350	1,096	1,096		▲ 0.350	▲ 0.350	
CP等買入(注6)	4,000	2022/6/30			11,781	3,984	▲ 0.001		0.009	17.5
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2022/6/28			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		2022/6/28			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、0.015%。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ア。

※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、0.076%。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ア。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
新型コロナウイルス対応金融支援特別 制度融資分	2022/6/28	2022/12/23	0	11,207
新型コロナウイルス対応金融支援特別 プロパー融資分	2022/6/28	2022/12/23	0	717

(参考) 2022/6/28時点の貸出残高 (億円)	
制度融資分(2022/4/1以降実行)	15,072
プロパー融資分(2022/4/1以降実行)	2,228
2022/3/31以前に実行された貸付け	616,228
合計	633,528

●2022年6月28日の予定

*4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数

*6月の米CB消費者信頼感指数

*2年利付国債入札(28,000億円、7/1発行)

◆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