

# Central Daily Market Report

2022年6月28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28日 需給速報	2022年6月29日 需給予想	2022年6月30日 当社予想
銀行券	▲ 300	▲ 600	▲ 700
財政	▲ 100	▲ 1,200	6,900
資金過不足	▲ 400	▲ 1,800	6,200
<b>金融調節</b>			
	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		1,000	
国債買入		1,400	
CP等買入	▲ 500	▲ 1,200	4,000
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			
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		500	
国債補充供給	▲ 17,500	20,200	17,500
米ドル資金供給(国債買入)			
当増減	▲ 111,000	17,400	10,200
当座預金残高	5,523,300	5,540,700	5,550,900
準備預金残高	4,860,000		
積み終了先	4,859,600		6月29日以降の残り所要積立額
超過準備	4,859,600		積数
非準備預金先	663,300		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	99.97%	日数
			43.33%

## ●2022年6月28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▲0.05~▲0.025%程度の調達で始まった。オファーサイドの資金量が減少傾向にあることからレートは前日比で僅かに上昇した。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、ショートタームでの引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.085%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>

28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、月末発行にあたり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。

## ●短期金融市場関連指標

2022/6/28	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.039				-	▲ 0.087	0.230	0.000	27,049.47	178.20	135.43-45	135.75-76
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.090						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.015	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.157						
2W							-	▲ 0.154						
3W							-	▲ 0.148						
1M							-	▲ 0.145						
3M			0.005				▲ 0.162	▲ 0.139						
6M							▲ 0.135	▲ 0.133						
1Y							▲ 0.125	▲ 0.129						
日付		6/21	6/22	6/23	6/24	6/27								
日銀当預残		5,650,000	5,624,400	5,625,400	5,632,500	5,634,300								
準備預金残		4,964,500	4,946,400	4,954,500	4,955,300	4,959,800								
マネタリーベース		6,896,100	6,871,200	6,873,800	6,881,600	6,883,600								
無担O/N加重平均		▲0.046%	▲0.047%	▲0.047%	▲0.040%	▲0.040%								
コール市場残高		167,109	171,011	164,708	169,181	163,462								
うち無担		141,621	141,894	138,575	140,165	134,522								
うちO/N		65,563	64,256	60,597	61,877	56,464								
うち有担		25,488	29,117	26,133	29,016	28,940								

## ●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)
2年利付国債	438	0.005%	28,000	2022/7/1	2024/7/1	89,850.0	23,558.0	100.1000	▲0.0440%	59.1854%	100.1090	▲0.0490%	4,433.0

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2022/6/29			7,450	1,000		0.026	0.026	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2022/6/28	2022/6/29	▲0.350	16,878	16,878		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2022/6/28	2022/6/29	▲0.350	650	650		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給		2022/6/30	2022/7/7	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		2022/6/29			1375	1375				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2022/6/29			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、0.055%。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29日の予定

*5月の商業動態統計速報	*1-3月期の米GDP確報値
*6月の消費動向調査	

◆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り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