

Central Daily Market Report

2023年5月15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	2023年5月15日 需給速報	2023年5月16日 需給予想	2023年5月17日 当社予想			
銀行券	1,500	1,500	1,500			
財政	700	▲ 25,600	▲ 2,000			
資金過不足	2,200	▲ 24,100	▲ 500			
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	13,700					
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 200		
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 気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 28,600	24,400		28,600		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	11,300	8,300	▲ 500			
当座預金残高	5,450,600	5,458,900	5,458,400			
準備預金残高	4,833,900					
積み終了先	4,833,900			5月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,833,900			積数	4,008,700	
非準備預金先	616,700			1日平均	129,300	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					4,008,700	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2023年5月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.03~▲0.01%近辺の出会いが始まった。前週からレート水準が上昇傾向となる中で積み最終日を迎えたが、ビッドサイドには調達余力を残していた先も多く、総じて取り上げる展開となった。一巡後は、ビッド数が減少したものの、調達を継続する先も複数見られ、▲0.01%近辺で散発的な出会いとなった。ターム物は新積み期スタートの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、▲0.10~▲0.085%程度での出会いとなった。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>

15日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2023/5/15	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		
	単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	前日比	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.050	0.001	▲ 0.023					-	▲ 0.091	0.405	0.025	29,626.34	238.04	135.81-83	135.95-97
T/N								-	▲ 0.099						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.020	▲ 0.045					-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.030	▲ 0.003	▲ 0.023					-	▲ 0.132						
3W								-	▲ 0.142						
1M	▲ 0.050	0.000	▲ 0.031					-	▲ 0.150						
3M								▲ 0.175	▲ 0.156						
6M								▲ 0.175	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.162	▲ 0.102						
日付		5/8	5/9	5/10	5/11	5/12									
日銀当預残	5,468,000	5,483,600	5,453,400	5,452,700	5,439,300										
準備預金残	4,775,200	4,798,500	4,778,700	4,763,900	4,770,900										
マネタリーベース	6,741,900	6,754,700	6,722,000	6,720,100	6,705,100										
無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.070%	▲0.061%	▲0.046%	▲0.030%										
コール市場残高	183,908	179,426	189,497	186,666	182,638										
うち無担	156,980	154,773	162,548	160,069	155,390										
うちO/N	88,407	85,300	93,565	89,736	87,127										
うち有担	26,928	24,653	26,949	26,597	27,248										

●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1非償格募入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	158	0.100%	25,000	2023/5/16	2028/3/20	75,248.0	20,319.00	99,9000	0.1200%	13.5990%	99.9200	0.1160%	4,671.0	-

●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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/16		0.120	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		2023/5/16		0.315	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/15	2023/5/16	▲0.350	28,587	28,587		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/15	2023/5/16	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り。国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。

※1固定利回較差の結果、10年利付国債370回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。※2固定利回較差の結果、10年利付国債359回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2023年5月16日の予定

*4月の米小売売上高	*3月の米企業在庫	*交付税特別会計借入
*4月の米鉱工業生産・設備稼働率	*1-3月期のユーロ圏GDP2次速報	(13,000億円、5/23借入)

◆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