

# Central Daily Market Report

2023年5月18日(木)

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18日 需給速報	2023年5月19日 需給予想	2023年5月22日 当社予想			
銀行券	300	700	1,000			
財政	▲ 11,200	4,900	▲ 8,000			
資金過不足	▲ 10,900	5,600	▲ 7,000			
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		16,000				
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			▲ 500			
新型コロナウイルス感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 25,600	25,500	25,600			
当預増減	▲ 11,100	46,200	▲ 7,000			
当座預金残高	5,419,500	5,465,700	5,458,700			
準備預金残高	4,724,800					
積み終了先	4,707,400			5月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,692,700			積数	52,400	
非準備預金先	694,700			1日平均	1,900	
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	98.69%	日数	9.68%		

## ●2023年5月18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▲0.04~▲0.03%近辺の出合いが始まった。レート水準は前日比で概ね横這い圏での推移となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.120~▲0.085%程度での出合いとなった。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>

18日はTB1Y物(第1157回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。この他、6M物にも出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/5/18	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	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.034					-	▲ 0.093	0.380	0.020	30,573.93	480.34	137.59-62	137.81-83
T/N								-	▲ 0.102						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.003	▲ 0.021					-	▲ 0.124						
2W			▲ 0.035					-	▲ 0.136						
3W			▲ 0.005					-	▲ 0.144						
1M	▲ 0.030	0.080	▲ 0.011					-	▲ 0.151						
3M								▲ 0.171	▲ 0.157						
6M								▲ 0.175	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.137	▲ 0.102						
日付		5/11	5/12	5/15	5/16	5/17									
日銀当預残	5,452,700	5,439,300	5,450,600	5,427,600	5,430,600										
準備預金残	4,763,900	4,770,900	4,833,900	4,739,400	4,741,700										
マネタリーベース	6,720,100	6,705,100	6,714,900	6,690,500	6,693,000										
無担O/N加重平均	▲ 0.046%	▲ 0.030%	▲ 0.023%	▲ 0.034%	▲ 0.033%										
コール市場残高	186,666	182,638	174,129	183,781	181,801										
うち無担	160,069	155,390	145,485	155,183	155,264										
うちO/N	89,736	87,127	77,572	89,940	88,281										
うち有担	26,597	27,248	28,644	28,598	26,537										

## ●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	1157	-	35,000	2023/5/22	2024/5/20	94,609.0	28,545.7	100.1250	▲0.1251%	89.4347%	100.1370	▲0.1371%	6,454.0
国有林野借入	-	-	491	2023/5/25	2028/5/25	2,565.0	491.00		0.1000%	19.4502%		0.0930%	

## ●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		2023/5/19		0.140	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		2023/5/19		0.330	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/5/19			7,104	4,251	0.003		0.005	63.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/5/19			11,077	5,007	0.000		0.001	63.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/5/19			14,080	5,757	0.011		0.013	31.4
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/5/19			4,107	1,002	0.023		0.023	96.0
社債等買入	1,000	2023/5/23			2,214	1,000	0.216		0.232	27.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/18	2023/5/19	▲0.350	25,496	25,496		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/18	2023/5/19	▲0.350	0	0				

\*オペの種類が、国債補完供給(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19日の予定

*4月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.4%)	*3月の第3次産業活動指数 *3月の石油等消費動態統計	*国庫短期証券(1158回)入札 (3ヶ月、63,000億円、5/22発行)	*流動性供給入札 (5,000億円、5/22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