

Central Daily Market Report

2023年5月23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	2023年5月23日 需給速報	2023年5月24日 需給予想	2023年5月25日 当社予想			
銀行券	500	100	1,000			
財政	▲ 4,200	▲ 1,900	13,000			
資金過不足	▲ 3,700	▲ 1,800	14,000			
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			7,700	▲ 7,900		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入				▲ 400		
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感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 27,400	28,800		27,400		
当増減	▲ 1,300	26,000		14,000		
当座預金残高	5,429,600	5,455,600	5,469,600			
準備預金残高	4,730,300					
積み終了先	4,726,500			5月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,726,300			積数	17,700	
非準備預金先	699,300			1日平均	800	
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	99.56%	日数	25.81%		

●2023年5月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.045~▲0.035%の出会いで始まった。大手行がビッド水準を引き下げたことから、出会い水準は前日比で低下した。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.150~▲0.100%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>

23日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、無難な結果となった。マーケットで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、一部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

2023/5/23	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	▲ 0.037					-	▲ 0.107	0.395	0.015	30,957.77	▲ 129.05	138.66-68	138.36-37
T/N								-	▲ 0.128						
S/N								-	-						
1W				▲ 0.035				-	▲ 0.140						
2W	▲ 0.048	▲ 0.039	▲ 0.046					-	▲ 0.149						
3W								-	▲ 0.154						
1M				▲ 0.035				-	▲ 0.158						
3M								▲ 0.170	▲ 0.162						
6M								▲ 0.175	▲ 0.134						
1Y								▲ 0.143	▲ 0.102						
日付		5/16	5/17	5/18	5/19	5/22									
日銀当預残		5,427,600	5,430,600	5,419,500	5,438,400	5,430,900									
準備預金残		4,739,400	4,741,700	4,724,800	4,728,300	4,733,500									
マネタリーベース		6,690,500	6,693,000	6,681,600	6,699,700	6,691,500									
無担O/N加重平均		▲ 0.034%	▲ 0.033%	▲ 0.034%	▲ 0.031%	▲ 0.034%									
コール市場残高		183,781	181,801	181,910	190,555	186,571									
うち無担		155,183	155,264	154,278	162,606	160,716									
うちO/N		89,940	88,281	85,595	92,973	89,663									
うち有担		28,598	26,537	27,632	27,949	25,855									

●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	素分率	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)
物価連動10年	28	0.005%	2,500	2023/5/24	2033/3/10	8,732.0	2,498.0	106.2500	▲0.5950%	87.0860%			
交付税特会	-	-	13,000	2023/5/31	2023/11/30	471,170.0	13,000.28		0.0000%	2.7592%		0.0000%	

●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	2023/5/24			5,723	1,003	0.003		0.003	49.4
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/24		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		2023/5/24		0.300	0	0				
米ドル資金供給		2023/5/25	2023/6/1	5.330	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/23	2023/5/24	▲0.350	27,433	27,433		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利・金額無制限＞		2023/5/24	2023/6/7	0.000	7,715	7,715				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/23	2023/5/24	▲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24日の予定

*4月の英消費者物価指数

◆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