

Central Daily Market Report

2023年5月24日(水)

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24日 需給速報	2023年5月25日 需給予想	2023年5月26日 当社予想			
銀行券	100	▲ 300	▲ 500			
財政	▲ 1,600	15,800	5,000			
資金過不足	▲ 1,500	15,500	4,500			
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	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			17,200			
CP等買入		▲ 400	▲ 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				▲ 900		
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						▲ 5,400
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 29,800	27,400	29,800			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増減	▲ 3,500	61,400	▲ 900			
当座預金残高	5,426,100	5,487,500	5,486,600			
準備預金残高	4,730,900					
積み終了先	4,728,600			5月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,727,300			積数	14,200	
非準備預金先	695,200			1日平均	600	
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	99.65%	日数	29.03%		

●2023年5月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.055~▲0.040%の出合いで始まった。オファーレートが低下する中、ビッドサイドの調達意欲も減退し、出合い水準は前日比で低下となった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.200~▲0.150%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>

24日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

<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

2023/5/24	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	▲ 0.047					-	▲ 0.153	0.405	0.010	30,682.68	▲ 275.09	138.60-62	138.64-66
T/N								-	▲ 0.210						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.005	▲ 0.040					-	▲ 0.187						
2W			▲ 0.050					-	▲ 0.178						
3W			▲ 0.010					-	▲ 0.172						
1M								-	▲ 0.166						
3M			0.020					▲ 0.175	▲ 0.163						
6M								▲ 0.175	▲ 0.135						
1Y								▲ 0.145	▲ 0.102						
日付		5/17	5/18	5/19	5/22	5/23									
日銀当預残	5,430,600	5,419,500	5,438,400	5,430,900	5,429,600										
準備預金残	4,741,700	4,724,800	4,728,300	4,733,500	4,730,300										
マネタリーベース	6,693,000	6,681,600	6,699,700	6,691,500	6,689,700										
無担O/N加重平均	▲ 0.033%	▲ 0.034%	▲ 0.031%	▲ 0.034%	▲ 0.037%										
コール市場残高	181,801	181,910	190,555	186,571	191,231										
うち無担	155,264	154,278	162,606	160,716	164,353										
うちO/N	88,281	85,595	92,973	89,663	93,260										
うち有担	26,537	27,632	27,949	25,855	26,878										

●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	募入最高利率	棄分率	募入平均価格	募入平均利率	第1非価格競争入札(億円)
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		2023/5/25		0.105	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		2023/5/25		0.285	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/5/25			7,597	4,252	▲0.007		▲0.003	33.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/5/25			12,634	5,006	▲0.001		▲0.001	85.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/5/25			14,190	5,756	0.000		0.002	46.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/5/25			4,385	2,009	0.008		0.010	56.3
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/24	2023/5/25	▲0.350	29,811	29,811		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/24	2023/5/25	▲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25日の予定

*月例経済報告	*1-3月期の米GDP改定値	*40年利付国債入札(7,000億円、5/26発行)
◆本資料は信頼できるとさ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		