

Central Daily Market Report

2023年5月25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25日 需給速報	2023年5月26日 需給予想	2023年5月29日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 100	▲ 500			
財政	15,400	12,000	▲ 2,000			
資金過不足	15,200	11,900	▲ 2,500			
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	17,200					
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
国債補充供給	▲ 29,100	29,800		29,100		
当預増減	32,000	35,400		▲ 2,500		
当座預金残高	5,458,100	5,493,500		5,491,000		
準備預金残高	4,755,400					
積み終了先	4,753,500			5月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,753,500			積数	12,300	
非準備預金先	702,700			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	99.69%		日数	32.26%	

●2023年5月25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▲0.065~▲0.055%の出会いで始まった。ビッドサイドの消極姿勢から、引き続きギブン地合いとなった。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。ターム物は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、▲0.250~▲0.150%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>

25日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2023/5/25	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	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	▲ 0.059					-	▲ 0.173	0.425	0.020	30,801.13	118.45	139.30-32	139.39-41
T/N								-	▲ 0.257						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.058	▲ 0.003	▲ 0.038					-	▲ 0.238						
2W	▲ 0.070	0.040	▲ 0.042					-	▲ 0.201						
3W								-	▲ 0.187						
1M								-	▲ 0.186						
3M			0.011					▲ 0.190	▲ 0.168						
6M								▲ 0.175	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.145	▲ 0.102						
日付		5/18	5/19	5/22	5/23	5/24									
日銀当預残	5,419,500	5,438,400	5,430,900	5,429,600	5,426,100										
準備預金残	4,724,800	4,728,300	4,733,500	4,730,300	4,731,100										
マネタリーベース	6,681,600	6,699,700	6,691,500	6,689,700	6,686,100										
無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.031%	▲0.034%	▲0.037%	▲0.047%										
コール市場残高	181,910	190,555	186,571	191,231	192,173										
うち無担	154,278	162,606	160,716	164,353	166,315										
うちO/N	85,595	92,973	89,663	93,260	93,822										
うち有担	27,632	27,949	25,855	26,878	25,858										

●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	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)
40年利付国債	16	1.300%	7,000	2023/5/26	2063/3/20	16,632.0	6,996.0	97.4000	1.3850%	53.9393%			

●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		2023/5/26		0.095	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		2023/5/26		0.280	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/25	2023/5/26	▲0.450	29,056	29,056		▲0.450	▲0.451	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/25	2023/5/26	▲0.450	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26日の予定

*5月の都区部消費者物価指数(GPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.3%)
*4月の企業向けサービス価格指数

*4月の米個人所得・消費支出
*4月の米耐久財新規受注

*国庫短期証券(1159回)入札
(3ヶ月、63,000億円、5/29発行)
*交付税特別会計借入
(13,000億円、6/2借入)

◆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