

Central Daily Market Report

2023年5月26日(金)

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26日 需給速報	2023年5月29日 需給予想	2023年5月30日 当社予想			
銀行券	▲ 100	500	1,000			
財政	10,900	▲ 12,200	▲ 2,000			
資金過不足	10,800	▲ 11,700	▲ 1,000			
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						
CP等買入		▲ 200		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入				▲ 100		
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	▲ 26,800	29,100		26,800		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当増増減	7,500	14,700		▲ 1,000		
当座預金残高	5,465,600	5,480,300		5,479,300		
準備預金残高	4,775,200					
積み終了先	4,774,400			5月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,773,500			積数	7,200	
非準備預金先	690,400			1日平均	400	
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	99.82%	日数	41.94%		

●2023年5月26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▲0.07~▲0.06%の出合いが始まった。週末3日積みの取引となったが、ビッドサイドに取り上がる動きは見られなかった。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、▲0.150~▲0.100%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>

26日はTB3M物(第1159回)の入札が実施され、テールの流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、横ばい圏で推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。
また、本日はCP等買入オペが事前予定通り4,000億円で オファーされた。結果は、全取レート+0.002%、平均落札レート+0.014%となった。

●短期金融市場関連指標

2023/5/26	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	▲ 0.063					-	▲ 0.108	0.415	▲ 0.010	30,916.31	115.18	140.01-03	139.53-54
T/N								-	▲ 0.144						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.161						
2W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.044					-	▲ 0.170						
3W			▲ 0.037					-	▲ 0.171						
1M								-	▲ 0.172						
3M								▲ 0.174	▲ 0.166						
6M								▲ 0.175	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.153	▲ 0.102						
日付		5/19	5/22	5/23	5/24	5/25									
日銀当預残	5,438,400	5,430,900	5,429,600	5,426,100	5,458,100										
準備預金残	4,728,300	4,733,500	4,730,300	4,731,100	4,755,500										
マネタリーベース	6,699,700	6,691,500	6,689,700	6,686,100	6,718,300										
無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.034%	▲0.037%	▲0.047%	▲0.059%										
コール市場残高	190,555	186,571	191,231	192,173	191,968										
うち無担	162,606	160,716	164,353	166,315	167,871										
うちO/N	92,973	89,663	93,260	93,822	92,138										
うち有担	27,949	25,855	26,878	25,858	24,097										

●入札結果

名称	回数	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	業分率	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)
国庫短期証券	1159	-	63,000	2023/5/29	2023/8/28	136,209.0	51,061.8	100.0410	▲0.1643%	64.7974%	100.0447	▲0.1792%	11,937.0
交付税特会	-	-	13,000	2023/6/2	2023/12/4	471,434.0	13,000.64		0.0000%	2.7577%		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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/29		0.075	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		2023/5/29		0.265	0	0				
CP等買入	4,000	2023/5/31			7,188	3,997		0.002	0.014	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/26	2023/5/29	▲0.550	26,797	26,797		▲0.550	▲0.550	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/26	2023/5/29	▲0.550	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29日の予定

*New York祝日(Memorial Day)

*London祝日(Spring Bank Holiday)

◆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