

Central Daily Market Report

2023年5月29日(月)
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29日 需給速報	2023年5月30日 需給予想	2023年5月31日 当社予想			
銀行券	400	700	1,300			
財政	▲ 11,700	1,000	8,000			
資金過不足	▲ 11,300	1,700	9,300			
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		14,700				
CP等買入		▲ 300	▲ 300	4,000		
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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 37,400	26,800		37,400		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当増減	▲ 22,300	53,500	13,300			
当座預金残高	5,443,300	5,496,800	5,510,100			
準備預金残高	4,737,600					
積み終了先	4,736,800			5月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,736,800			積数	6,300	
非準備預金先	705,700			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	99.84%	日数	45.16%		

●2023年5月29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▲0.065~▲0.05%の
出合いで始まった。ビッドサイドが消極的であったため引き続きギブン地合
いとなった。しかし、出合い水準は前営業日から概ね横這い圏となり、レート
の低下は一服した。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散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.160~▲0.110%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>

29日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、月末発行にあたり複数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

2023/5/29	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	▲ 0.062					-	▲ 0.124	0.435	0.020	31,233.54	317.23	140.88-90	140.44-46
T/N								-	▲ 0.151						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.060	▲ 0.061					-	▲ 0.159						
2W	▲ 0.068	▲ 0.003	▲ 0.050					-	▲ 0.166						
3W								-	▲ 0.166						
1M			0.180					-	▲ 0.168						
3M								▲ 0.174	▲ 0.164						
6M								▲ 0.175	▲ 0.135						
1Y								▲ 0.153	▲ 0.102						
日付		5/22	5/23	5/24	5/25	5/26									
日銀当預残		5,430,900	5,429,600	5,426,100	5,458,100	5,465,600									
準備預金残		4,733,500	4,730,300	4,731,100	4,755,500	4,775,500									
マネタリーベース		6,691,500	6,689,700	6,686,100	6,718,300	6,725,900									
無担O/N加重平均		▲0.034%	▲0.037%	▲0.047%	▲0.059%	▲0.063%									
コール市場残高		186,571	191,231	192,173	191,968	193,192									
うち無担		160,716	164,353	166,315	167,871	167,263									
うちO/N		89,663	93,260	93,822	92,138	92,380									
うち有担		25,855	26,878	25,858	24,097	25,929									

●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	案分率	募入 平均価格	募入 平均利回	募入 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		2023/5/30		0.085	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		2023/5/30		0.275	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/5/30			6,723	5,000	▲0.011		▲0.001	78.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/5/30			13,653	5,762	0.006		0.007	33.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/5/30			4,746	2,008	0.007		0.008	52.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/5/30			2,284	1,005	0.006		0.007	98.6
国債買入(物価連動債)	600	2023/5/30			1,872	601	▲0.170		▲0.300	77.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/29	2023/5/30	▲0.350	37,317	37,317		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/29	2023/5/30	▲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30日の予定

*4月の完全失業率(市場予想:2.7%)	*3月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*2年利付国債入札 (29,000億円、6/1発行)
*4月の有効求人倍率(市場予想:1.32倍)	*5月の米CB消費者信頼感指数	

◆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