

# Central Daily Market Report

2023年6月2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6月2日 需給速報	2023年6月5日 需給予想	2023年6月6日 当社予想			
銀行券	700	700	1,200			
財政	▲ 56,100	▲ 4,100	2,000			
資金過不足	▲ 55,400	▲ 3,400	3,200			
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			12,300			
CP等買入				▲ 300		
貸出支援基金(成)		▲ 4,600				
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 800				
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						
国債補充供給	▲ 34,100	30,800		34,100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 64,100		42,700			3,200
当座預金残高	5,336,200		5,378,900			5,382,100
準備預金残高	4,637,100					
積み終了先	4,636,700			6月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,636,700			積数		3,100
非準備預金先	699,100			1日平均		300
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	99.92%	日数	64.52%		

## ●2023年6月2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▲0.075~▲0.05%程度の出合いで始まった。引き続きオファーサイドの資金運用ニーズが強く、出合い水準は低位での推移となった。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、▲0.12~▲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>

2日はTB3M物(第1160回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は一部の業態で大型発行が観測された。発行レートは概ね幅広い圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/6/2	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	▲ 0.072					-	▲ 0.102	0.410	▲ 0.005	31,524.22	376.21	138.72-75	138.99-02
T/N								-	▲ 0.116						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.060					-	▲ 0.138						
2W								-	▲ 0.144						
3W								-	▲ 0.152						
1M			0.250					-	▲ 0.174						
3M								▲ 0.185	▲ 0.162						
6M								▲ 0.180	▲ 0.134						
1Y								▲ 0.162	▲ 0.102						
日付		5/26	5/29	5/30	5/31	6/1									
日銀当預残		5,465,600	5,443,300	5,473,100	5,464,500	5,400,300									
準備預金残		4,775,500	4,737,600	4,760,200	4,760,700	4,693,600									
マネタリーベース		6,725,900	6,703,100	6,732,200	6,722,800	6,658,500									
無担O/N加重平均		▲0.063%	▲0.062%	▲0.064%	▲0.071%	▲0.070%									
コール市場残高		193,192	186,377	194,596	183,725	188,542									
うち無担		167,263	162,964	170,952	159,567	165,556									
うちO/N		92,380	87,391	94,899	91,524	89,193									
うち有担		25,929	23,413	23,644	24,158	22,986									

## ●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	案分率	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	1160	-	63,000	2023/6/5	2023/9/4	146,252.0	51,062.3	100.0400	▲0.1603%	27.3624%	100.0425	▲0.1703%	11,937.0

## ●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		2023/6/5		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		2023/6/5		0.285	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/6/5		0.257	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/6/5			3,774	1,500	▲0.017		0.009	10.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/6/5			7,976	4,252	▲0.005		▲0.004	49.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/6/5			10,610	4,505	▲0.004		▲0.003	36.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/6/5			4,480	2,006	▲0.001		0.001	63.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/2	2023/6/5	▲0.350	34,089	34,089		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/2	2023/6/5	▲0.350	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。※3固定利回較差の結果、10年利付国債360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6月5日の予定

\*6月の日銀当座預金増減要因見込み

\*5月のISM非製造業景況指数

\*4月の米製造業新規受注・出荷・在庫

◆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