

Central Daily Market Report

2023年6月6日(火)

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6日 需給速報	2023年6月7日 需給予想	2023年6月8日 当社予想			
銀行券	1,100	0	▲100			
財政	▲5,300	▲11,500	2,000			
資金過不足	▲4,200	▲11,500	1,900			
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			8,000	▲7,700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲400				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲400				
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	▲30,500	34,100	30,500			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲1,400	20,300	1,900			
当座預金残高	5,342,900	5,363,200	5,365,100			
準備預金残高	4,675,400					
積み終了先	4,674,900			6月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,674,900			積数	2,200	
非準備預金先	667,500			1日平均	200	
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	99.95%	日数	70.97%		

●2023年6月6日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.065~▲0.045%程度での出会いが始まった。前日からレートが上昇基調となるなか、引き続きビッドサイドからは堅調な調達意欲が見られたため、出会い水準は前日対比で上昇した。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は終了した。ターム物はショートターム物での引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.085%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>

6日は短国買入オベが前回と同額の1,000億円でオファーされ、無難な結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/6/6	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	▲0.058					-	▲0.096	0.420	▲0.010	32,506.78	289.35	139.41-43	139.30-32
T/N								-	▲0.100						
S/N								-	-						
1W	▲0.065	▲0.025	▲0.057					-	▲0.131						
2W			▲0.060					-	▲0.138						
3W			0.001					-	▲0.151						
1M								-	▲0.172						
3M								▲0.185	▲0.164						
6M								▲0.180	▲0.134						
1Y								▲0.167	▲0.102						
										日付	5/30	5/31	6/1	6/2	6/5
										日銀当預残	5,473,100	5,464,500	5,400,300	5,336,200	5,344,300
										準備預金残	4,760,200	4,760,700	4,693,600	4,637,100	4,652,500
										マネタリーベース	6,732,200	6,722,800	6,658,500	6,593,700	6,601,100
										無担O/N加重平均	▲0.064%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.072%	▲0.068%
										コール市場残高	194,596	183,725	188,542	190,756	181,471
										うち無担	170,952	159,567	165,556	166,029	155,047
										うちO/N	94,899	91,524	89,193	85,846	75,644
										うち有担	23,644	24,158	22,986	24,727	26,424

●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I非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
30年利付国債	78	1.40%	9,000	2023/6/7	2053/3/20	22,403.0	7,284.0	102,950.0	1.2630%	34.0713%	103.0900	1.2570%	1,709	
交付税特会	-	-	13,000	2023/6/15	2023/12/15	497,530.0	13,000.39		0.0000%	2.6130%		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)	授分レート・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	授分比率
国庫短期証券買入	1,000	2023/6/7			5,467	1,001	0.002		0.003	23.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/6/7		0.070	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		2023/6/7		0.270	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		2023/6/7		0.240	0	0				
米ドル資金供給		2023/6/8	2023/6/15	5.330	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/6	2023/6/7	▲0.350	30,565	30,565		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/6/7	2023/6/21	0.000	8,011	8,011				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/6	2023/6/7	▲0.350	5	5		▲0.350	▲0.350	

*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。※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7日の予定

*5月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*4月の米貿易収支
*4月の景気動向指数速報	*4月の米消費者信用残高

◆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