

Central Daily Market Report

2023年6月7日(水)

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7日 需給速報	2023年6月8日 需給予想	2023年6月9日 当社予想			
銀行券	100	▲ 100	0			
財政	▲ 10,900	4,100	▲ 3,000			
資金過不足	▲ 10,800	4,000	▲ 3,000			
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	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			▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			▲ 200			
新型コロナウイルス感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 35,300	30,500	35,300			
当預増減	▲ 14,300	39,000	▲ 3,000			
当座預金残高	5,328,600	5,367,600	5,364,600			
準備預金残高	4,666,600					
積み終了先	4,666,000			6月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,666,000			積数	1,600	
非準備預金先	662,000			1日平均	200	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額						4,011,000
準備預金進捗率	実績	99.96%	日数	74.19%		

●2023年6月7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▲0.055~▲0.04%程度での出合いが始まった。積み期は終盤に入り、取り手サイドからの調達ニーズが一層と増してきたことで、出合いの水準は前営業日対比で上昇する展開となった。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、▲0.095~▲0.085%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>

7日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数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あった。

●短期金融市場関連指標

2023/6/7	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.047				-	▲ 0.090	0.415	▲ 0.005	31,913.74	▲ 593.04	139.52-54	139.43-45
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.122						
2W			▲ 0.050				-	▲ 0.133						
3W	▲ 0.015	0.000	▲ 0.008				-	▲ 0.146						
1M							-	▲ 0.171						
3M							▲ 0.184	▲ 0.163						
6M							▲ 0.180	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.102						
日付		5/31	6/1	6/2	6/5	6/6								
日銀当預残	5,464,500	5,400,300	5,336,200	5,344,300	5,342,900									
準備預金残	4,760,700	4,693,600	4,637,100	4,652,500	4,675,400									
マネタリーベース	6,722,800	6,658,500	6,593,700	6,601,100	6,598,700									
無担O/N加重平均	▲ 0.071%	▲ 0.070%	▲ 0.072%	▲ 0.068%	▲ 0.058%									
コール市場残高	183,725	188,542	190,756	181,471	197,079									
うち無担	159,567	165,556	166,029	155,047	170,297									
うちO/N	91,524	89,193	85,846	75,644	90,144									
うち有担	24,158	22,986	24,727	26,424	26,782									

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	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		2023/6/8		0.080	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		2023/6/8		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		2023/6/8		0.255	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/7	2023/6/8	▲ 0.350	32,271	32,271		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/7	2023/6/8	▲ 0.350	2,938	2,938		▲ 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8日の予定

*1-3月期のGDP 2次速報 (市場予想:前期比年率+1.9%)	*4月の米卸売売上高 *1-3月期のユーロ圏GDP確報値	*国庫短期証券(1161回)入札 (6ヶ月、40,000億円、6/12発行)	*エネルギー対策借入 (7,900億円、6/20借入)
*4月の国際収支		*流動性供給入札 (5,000億円、6/9発行)	
*5月の景気ウォッチャー調査			

◆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