

Central Daily Market Report

2023年6月8日(木)

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8日 需給速報	2023年6月9日 需給予想	2023年6月12日 当社予想			
銀行券	▲ 100	500	600			
財政	1,200	▲ 8,300	▲ 4,000			
資金過不足	1,100	▲ 7,800	▲ 3,400			
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		▲ 100		▲ 500		
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		▲ 2,400		
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						
国債補充供給	▲ 31,600	35,300		31,600		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	4,500	20,900		▲ 3,400		
当座預金残高	5,333,100	5,354,000		5,350,600		
準備預金残高	4,695,000					
積み終了先	4,694,500				6月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,694,500				積数	1,100
非準備預金先	638,100				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	99.97%	日数	77.42%		

●2023年6月8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▲0.045~▲0.03%程度での出合いで始まった。引き続き取り手サイドからの調達ニーズが強く、出合いの水準は前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。

<レボ市場>

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>

8日はTB6M物(第1161回)の入札が実施され、順調な消化となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりと推移した。

<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、按分レート▲0.007%、平均レート+0.006%と前回(全取+0.002%、平均+0.014%)比で、最低落札レート、平均レートとも低下した。

●短期金融市場関連指標

2023/6/8	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レボレート 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	▲ 0.039				-	▲ 0.088	0.435	0.020	31,641.27	▲ 272.47	139.88-90	139.72-74
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.092						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.024				-	▲ 0.116						
2W	▲ 0.060	▲ 0.057	▲ 0.059				-	▲ 0.127						
3W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.007				-	▲ 0.138						
1M			0.100				-	▲ 0.166						
3M							▲ 0.182	▲ 0.161						
6M							▲ 0.168	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.167	▲ 0.102						
日付		6/1	6/2	6/5	6/6	6/7								
日銀当預残	5,400,300	5,336,200	5,344,300	5,342,900	5,328,600									
準備預金残	4,693,600	4,637,100	4,652,500	4,675,400	4,667,300									
マネタリーベース	6,658,500	6,593,700	6,601,100	6,598,700	6,584,300									
無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.072%	▲0.068%	▲0.058%	▲0.047%									
コール市場残高	188,542	190,756	181,471	197,079	192,431									
うち無担	165,556	166,029	155,047	170,297	166,059									
うちO/N	89,193	85,846	75,644	90,144	91,856									
うち有担	22,986	24,727	26,424	26,782	26,372									

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1161	-	40,000	2023/6/12	2023/12/11	103,220.0	32,766.5	100.0780	▲0.1563%	2.0919%	100.0840	▲0.1683%	7,233.0
流動性供給	383	-	5,000	2023/6/9	-	15,474.0	4,992.0	-	0.0030%	68.7280%	-	0.0020%	-
エネルギー対策	-	-	7,900	2023/6/20	2024/6/20	213,948.0	7,899.83	-	0.0000%	3.6925%	-	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		2023/6/9		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		2023/6/9		0.295	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		2023/6/9		0.265	0	0				
CP等買入	4,000	2023/6/13			5,646	3,996	▲0.007			5.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/8	2023/6/9	▲0.350	31,608	31,608		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/8	2023/6/9	▲0.350	27	27		▲0.350	▲0.350	

*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9日の予定

*5月のマネーストック	*国庫短期証券(1162回)入札
*4月の特定サービス産業動態統計速報	(3ヶ月、63,000億円、6/12発行)

◆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