

Central Daily Market Report

2023年6月9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9日 需給速報	2023年6月12日 需給予想	2023年6月13日 当社予想			
銀行券	500	0	▲ 100			
財政	▲ 8,500	▲ 100	3,000			
資金過不足	▲ 8,000	▲ 100	2,900			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		15,600				
CP等買入	▲ 500		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	▲ 2,400					
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	▲ 32,200	31,600	32,200			
※1ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	▲ 11,500	47,700	6,900			
当座預金残高	5,321,600	5,369,300	5,376,200			
準備預金残高	4,670,700					
積み終了先	4,670,600			6月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,670,400			積数	200	
非準備預金先	650,900			1日平均	0	
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	100.00%	日数	87.10%		

●2023年6月9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▲0.04~▲0.02%程度での出会いとなった。今積み期最後の週末3日積みとなった事で、取り手サイドの調達ニーズが一段と強まった結果、▲0.02%台での出会いが多く見られた。しかし、出会い一巡後は徐々にビッドが減少した事で、ギブン地合いに変化し、レートは▲0.04%程度まで低下する展開となった。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、▲0.09%~▲0.075%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>

9日はTB3M物(第1162回)の入札が実施され、堅調な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<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

2023/6/9	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	▲ 0.028					-	▲ 0.088	0.430	▲ 0.005	32,265.17	623.90	138.88-90	139.55-57
T/N								-	▲ 0.089						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.020					-	▲ 0.113						
2W			0.030					-	▲ 0.128						
3W								-	▲ 0.151						
1M								-	▲ 0.163						
3M								▲ 0.175	▲ 0.163						
6M								▲ 0.170	▲ 0.135						
1Y								▲ 0.170	▲ 0.102						
日付		6/2	6/5	6/6	6/7	6/8									
日銀当預残	5,336,200	5,344,300	5,342,900	5,328,600	5,333,100										
準備預金残	4,637,100	4,652,500	4,675,400	4,667,300	4,694,000										
マネタリーベース	6,593,700	6,601,100	6,598,700	6,584,300	6,588,800										
無担O/N加重平均	▲0.072%	▲0.068%	▲0.058%	▲0.047%	▲0.039%										
コール市場残高	190,756	181,471	197,079	192,431	188,920										
うち無担	166,029	155,047	170,297	166,059	163,844										
うちO/N	85,846	75,644	90,144	91,856	91,921										
うち有担	24,727	26,424	26,782	26,372	25,076										

●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	1162	-	63,000	2023/6/12	2023/9/11	135,393.0	51,062.5	100.0415	▲0.1663%	38.9658%	100.0447	▲0.1792%	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		2023/6/12		0.065	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		2023/6/12		0.275	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		2023/6/12		0.245	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/6/12			13,048	4,256	▲0.003		▲0.002	23.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/6/12			9,635	4,508	▲0.003		▲0.002	10.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/6/12			15,434	5,759	▲0.006		▲0.005	38.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/6/12			2,713	1,003	0.000		0.002	20.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/9	2023/6/12	▲0.350	31,861	31,861		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/9	2023/6/12	▲0.350	418	418		▲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12日の予定

*5月の企業物価指数	*5月の米財政収支
------------	-----------

◆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