

# Central Daily Market Report

2023年6月12日(月)  
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12日 需給速報	2023年6月13日 需給予想	2023年6月14日 当社予想			
銀行券	100	100	0			
財政	4,100	▲ 2,100	▲ 8,000			
資金過不足	4,200	▲ 2,000	▲ 8,000			
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						
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		4,000	▲ 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			▲ 100			
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 37,900	32,200	37,900			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	14,100	39,300	▲ 8,000			
当座預金残高	5,335,700	5,375,000	5,367,000			
準備預金残高	4,714,900					
積み終了先	4,714,800			6月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,714,800			積数	100	
非準備預金先	620,800			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	90.32%		

## ●2023年6月12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▲0.08~▲0.04%程度での出会いとなった。3日積み要因の剥落に加え、積みの進捗に目途が付いた先も多く、ビッド数が減少した。それに伴い、ビッドサイドのレート目線は前週末対比で低下し、▲0.05~▲0.04%程度での出会いが多く見られた。一巡後はオファー残りが目立つ中、レート水準は低下基調となり、最終的には▲0.08%近辺での出会いも見られた。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~▲0.080%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>

12日のアウトライイト市場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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/6/12	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	▲ 0.058					-	▲ 0.089	0.425	▲ 0.005	32,434.00	168.83	139.36-38	139.50-51
T/N								-	▲ 0.090						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.065					-	▲ 0.114						
2W	▲ 0.070	▲ 0.003	▲ 0.063					-	▲ 0.131						
3W								-	▲ 0.158						
1M								-	▲ 0.164						
3M			0.020					▲ 0.175	▲ 0.164						
6M								▲ 0.170	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.170	▲ 0.102						
										日付	6/5	6/6	6/7	6/8	6/9
										日銀当預残	5,344,300	5,342,900	5,328,600	5,333,100	5,321,600
										準備預金残	4,652,500	4,675,400	4,667,300	4,694,000	4,671,000
										マネタリーベース	6,601,100	6,598,700	6,584,300	6,588,800	6,576,800
										無担O/N加重平均	▲ 0.068%	▲ 0.058%	▲ 0.047%	▲ 0.039%	▲ 0.028%
										コール市場残高	181,471	197,079	192,431	188,920	197,115
										うち無担	155,047	170,297	166,059	163,844	171,264
										うちO/N	75,644	90,144	91,856	91,921	100,541
										うち有担	26,424	26,782	26,372	25,076	25,851

## ●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		2023/6/13		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		2023/6/13		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		2023/6/13		0.255	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/12	2023/6/13	▲ 0.350	38,047	38,047		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/12	2023/6/13	▲ 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、上取期間利回り。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13日の予定

*4-6月期の法人企業景気予測調査季報	*米FOMC(1日目) *5月の米消費者物価指数	*流動性供給入札 (5,000億円、6/14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