

Central Daily Market Report

2023年6月13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13日 需給速報	2023年6月14日 需給予想	2023年6月15日 当社予想			
銀行券	0	▲ 600	▲ 900			
財政	▲ 5,800	▲ 6,000	72,000			
資金過不足	▲ 5,800	▲ 6,600	71,100			
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			1,000			
国債買入						
CP等買入	4,000	▲ 500	▲ 300			
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				
新型コロナウイルス対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 40,200	37,900	40,200			
※ドル資金供給用担保国債供給						
当増減	▲ 4,700	34,300	71,100			
当座預金残高	5,331,000	5,365,300	5,436,400			
準備預金残高	4,676,300					
積み終了先	4,676,200			6月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,676,200			積数	100	
非準備預金先	654,700			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	93.55%		

●2023年6月13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▲0.087~▲0.078%程度での出会いとなった。引き続きビッド数が少なく、レート水準が一段と低下する中、実質的な下限域となる▲0.085%前後での出会いも多く見られた。一巡後もレート水準に変化はなく、散発的に出会いがみられた程度となった。
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、▲0.110~▲0.090%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>

13日は短国買入オペが前回と同額の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、五・十日発行にあたり複数の業態から発行が実施され、一部の業態では大型発行も見られた。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

2023/6/13	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	▲ 0.079					-	▲ 0.095	0.415	▲ 0.010	33,018.65	584.65	139.45-47	139.48-50
T/N								-	▲ 0.106						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.075	0.005	▲ 0.067					-	▲ 0.120						
2W			▲ 0.010					-	▲ 0.134						
3W								-	▲ 0.160						
1M								-	▲ 0.162						
3M	0.020	0.040	0.027					▲ 0.173	▲ 0.165						
6M								▲ 0.170	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.170	▲ 0.102						
日付		6/6	6/7	6/8	6/9	6/12									
日銀当預残		5,342,900	5,328,600	5,333,100	5,321,600	5,335,700									
準備預金残		4,675,400	4,667,300	4,694,000	4,671,000	4,714,900									
マネタリーベース		6,598,700	6,584,300	6,588,800	6,576,800	6,590,800									
無担O/N加重平均		▲0.058%	▲0.047%	▲0.039%	▲0.028%	▲0.058%									
コール市場残高		197,079	192,431	188,920	197,115	193,158									
うち無担		170,297	166,059	163,844	171,264	166,488									
うちO/N		90,144	91,856	91,921	100,541	94,835									
うち有担		26,782	26,372	25,076	25,851	26,670									

●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	棄分率	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)
流動性供給	384	-	5,000	2023/6/14	-	14,265.0	4,966.0		▲0.017%	48.7044%		▲0.019%	

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/6/14			7,082	1,002	0.005		0.005	46.8
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/6/14		0.075	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		2023/6/14		0.290	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		2023/6/14		0.260	0	0				
米ドル資金供給		2023/6/15	2023/6/22	5.380	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/13	2023/6/14	▲0.350	40,285	40,285		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/13	2023/6/14	▲0.350	54	54		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/6/14	2023/6/23		2	2		▲0.100	▲0.100	

*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14日の予定

*米FOMC(2日目)	*FRB 米経済見通し発表	*5月の米生産者物価指数
-------------	---------------	--------------

◆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