

Central Daily Market Report

2023年6月14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14日 需給速報	2023年6月15日 需給予想	2023年6月16日 当社予想			
銀行券	▲ 600	▲ 600	▲ 1,300			
財政	▲ 7,700	79,600	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 8,300	79,000	▲ 6,300			
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		▲ 300	▲ 600			
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						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 36,500	40,200	36,500			
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	▲ 3,900	114,800	▲ 6,300			
当座預金残高	5,327,100	5,441,900	5,435,600			
準備預金残高	4,652,700					
積み終了先	4,652,600			6月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,652,600			積数	0	
非準備預金先	674,400			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	96.77%		

●2023年6月14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~▲0.075%程度での出会いとなった。前日に比べ、オファーサイドの一部に運用ニーズの減退が見られた事で、全体のレート目線が僅かに上昇する展開となった。出会い一巡後も、積み最終日に向けた調整からビッドが継続され、▲0.07%台で散発的な出会いが見られた。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、▲0.115~▲0.085%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>

14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

2023/6/14	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	▲ 0.078					-	▲ 0.100	0.425	0.010	33,502.42	483.77	140.13-16	139.98-00
T/N								-	▲ 0.110						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.010	▲ 0.048					-	▲ 0.124						
2W	▲ 0.060	▲ 0.010	▲ 0.045					-	▲ 0.136						
3W								-	▲ 0.169						
1M								-	▲ 0.161						
3M	0.001	0.012	0.004					▲ 0.160	▲ 0.166						
6M								▲ 0.170	▲ 0.136						
1Y								▲ 0.170	▲ 0.102						
日付		6/7	6/8	6/9	6/12	6/13									
日銀当預残		5,328,600	5,333,100	5,321,600	5,335,700	5,331,000									
準備預金残		4,667,300	4,694,000	4,671,000	4,714,900	4,676,300									
マネタリーベース		6,584,300	6,588,800	6,576,800	6,590,800	6,586,100									
無担O/N加重平均		▲0.047%	▲0.039%	▲0.028%	▲0.058%	▲0.079%									
コール市場残高		192,431	188,920	197,115	193,158	182,485									
うち無担		166,059	163,844	171,264	166,488	155,103									
うちO/N		91,856	91,921	100,541	94,835	80,130									
うち有担		26,372	25,076	25,851	26,670	27,382									

●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		2023/6/15		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		2023/6/15		0.305	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		2023/6/15		0.275	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/14	2023/6/15	▲0.350	36,618	36,618		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/14	2023/6/15	▲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15日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、16日まで)	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(1163回)入札(3ヶ月、63,000億円、6/19発行)
*4月の機械受注統計(市場予想:電力除く民需、前月比+3%)	*5月の米小売売上高	
*5月の貿易統計	*5月の米鉱工業生産・設備稼働率	
*4月の第3次産業活動指数	*4月の米企業在庫	

◆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