

Central Daily Market Report

2023年6月20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20日 需給速報	2023年6月21日 需給予想	2023年6月22日 当社予想			
銀行券	▲ 800	▲ 700	▲ 1,500			
財政	70,100	▲ 5,700	4,000			
資金過不足	69,300	▲ 6,400	2,500			
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			8,900	▲ 8,000		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 1,500			1,000	
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	▲ 36,200	40,500		36,200		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	71,900	30,500			3,500	
当座預金残高	5,519,500	5,550,000			5,553,500	
準備預金残高	4,834,000					
積み終了先	4,828,100				6月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,827,200				積数	28,500
非準備預金先	685,500				1日平均	1,100
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額						3,883,300
準備預金進捗率	実績	99.27%	日数	16.67%		

●2023年6月20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、ビッドサイドにレートを引き下げる動きが広がった事で、出合い水準は前日に比べ低下した。朝方は邦銀業態からの調達を中心に▲0.075~▲0.065%程度での出合いとなり、一巡後も大きな変化は無く▲0.075%前後で散発的な出合いが見られた程度となった。ターム物は、月内エンドのショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.090~▲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>

20日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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

2023/6/20	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	売買参考統計値	前日比	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.069					-	▲ 0.088	0.385	▲ 0.005	33,388.91	18.49	141.89-91	141.77-78
T/N								-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.060					-	▲ 0.112						
2W	▲ 0.070	0.030	▲ 0.058					-	▲ 0.154						
3W			0.000					-	▲ 0.151						
1M			▲ 0.035					-	▲ 0.148						
3M								▲ 0.148	▲ 0.154						
6M								▲ 0.170	▲ 0.134						
1Y								▲ 0.148	▲ 0.102						
										日付	6/13	6/14	6/15	6/16	6/19
										日銀当預残	5,331,000	5,327,100	5,405,100	5,423,900	5,447,600
										準備預金残	4,676,300	4,652,700	4,754,500	4,738,600	4,774,900
										マネタリーベース	6,586,100	6,582,800	6,661,400	6,680,100	6,704,500
										無担O/N加重平均	▲0.079%	▲0.078%	▲0.070%	▲0.061%	▲0.064%
										コール市場残高	182,485	187,638	189,071	176,238	174,386
										うち無担	155,103	160,919	161,408	148,467	147,657
										うちO/N	80,130	85,376	88,215	77,865	75,600
										うち有担	27,382	26,719	27,663	27,771	26,729

●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	棄分率	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		2023/6/21		0.110	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		2023/6/21		0.315	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		2023/6/21		0.285	0	0				
米ドル資金供給		2023/6/22	2023/6/29	5.330	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/20	2023/6/21	▲0.350	36,237	36,237		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利・金額無制限＞		2023/6/21	2023/7/5	0.000	8,910	8,910				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/20	2023/6/21	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.360	

*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21日の予定

*鹿児島県金融経済懇談会において安達日銀審議委員講演	*5月の英消費者物価指数
*金融政策決定会合議事要旨(4月27・28日分)	

◆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