

# Central Daily Market Report

2023年6月22日(木)

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22日 需給速報	2023年6月23日 需給予想	2023年6月26日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 700	▲ 500			
財政	7,700	▲ 19,700	3,000			
資金過不足	6,800	▲ 20,400	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						
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	▲ 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	1,000		▲ 600			
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	▲ 35,500	37,400	35,500			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	10,400	14,000	2,500			
当座預金残高	5,520,000	5,534,000	5,536,500			
準備預金残高	4,843,300					
積み終了先	4,841,300			6月23日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,840,900			積数	21,600	
非準備預金先	676,700			1日平均	900	
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	99.44%	日数	23.33%		

## ●2023年6月22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、引き続き地銀業態を中心にビッドレートを引き下げる動きが見られた一方、▲0.08%近辺では大手行からのビッドが下支えとなったため、全体の出会い水準は前日比で小幅な低下に留まった。朝方は邦銀業態からの調達を中心に▲0.078~▲0.075%程度での出会いとなり、一巡後も大きな変化は無く同水準で散発的な出会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、▲0.09%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>

22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、小口の案件が中心であったが、一部の業態からは500~600億円規模の発行も実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/6/22	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	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	▲ 0.073					-	▲ 0.088	0.370	0.000	33,264.88	▲ 310.26	141.66-69	141.78-80
T/N								-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.078	▲ 0.010	▲ 0.064					-	▲ 0.108						
2W			0.010					-	▲ 0.137						
3W								-	▲ 0.139						
1M	0.013	0.025	0.015					-	▲ 0.139						
3M			0.025					▲ 0.148	▲ 0.151						
6M								▲ 0.170	▲ 0.132						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
										日付	6/15	6/16	6/19	6/20	6/21
										日銀当預残	5,405,100	5,423,900	5,447,600	5,519,500	5,509,600
										準備預金残	4,754,500	4,738,600	4,774,900	4,832,900	4,841,900
										マネタリーベース	6,661,400	6,680,100	6,704,500	6,777,100	6,767,900
										無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.061%	▲0.064%	▲0.069%	▲0.072%
										コール市場残高	189,071	176,238	174,386	176,656	175,017
										うち無担	161,408	148,467	147,657	148,726	147,577
										うちO/N	88,215	77,865	75,600	75,619	74,015
										うち有担	27,663	27,771	26,729	27,930	27,440

## ●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非備 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
5年利付国債	158	0.100%	25,000	2023/6/23	2028/3/20	78,191.0	20,309.00	100.1400	0.0700%	54.9513%	100.1500	0.0680%	4,671.0	10.00

## ●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		2023/6/23		0.130	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		2023/6/23		0.310	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/22	2023/6/23	▲0.350	35,437	35,437		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/22	2023/6/23	▲0.350	0	0				

\*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23日の予定

*5月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.1%)	*国庫短期証券(1165回)入札 (3ヶ月、63,000億円、6/26発行)
---	---

◆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