

Central Daily Market Report

2023年6月23日(金)

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23日 需給速報	2023年6月26日 需給予想	2023年6月27日 当社予想			
銀行券	▲ 700	▲ 100	▲ 1,000			
財政	▲ 20,100	9,000	5,000			
資金過不足	▲ 20,800	8,900	4,000			
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		16,800				
CP等買入	▲ 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		▲ 600		▲ 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	▲ 31,500	35,500		31,500		
※ドル資金供給用担保確保供給						
当預増減	▲ 17,900	56,800	4,000			
当座預金残高	5,502,100	5,558,900	5,562,900			
準備預金残高	4,843,400					
積み終了先	4,841,400			6月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,841,400			積数	15,800	
非準備預金先	658,700			1日平均	800	
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	99.59%	日数	33.33%		

●2023年6月23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、週末要因の影響なども特段見られず、前日比でほぼ横ばい水準での取引となった。朝方は邦銀業態からの調達を中心に▲0.078~▲0.075%程度での出会いが中心となり、一巡後も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、四半期末を控え閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%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>

23日はTB3M物(第1165回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小甘く推移した。

<CP市場>

CP市場は、入札案件が少なく閑散なマーケットとなった。発行レートは概ね横這い圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/6/23	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	▲ 0.074					-	▲ 0.085	0.365	▲ 0.005	32,781.54	▲ 483.34	143.02-04	142.88-90
T/N								-	▲ 0.087						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.075	0.008	▲ 0.053					-	▲ 0.121						
2W								-	▲ 0.131						
3W								-	▲ 0.135						
1M			0.130					-	▲ 0.137						
3M								▲ 0.122	▲ 0.148						
6M								▲ 0.170	▲ 0.132						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		6/16	6/19	6/20	6/21	6/22									
日銀当預残		5,423,900	5,447,600	5,519,500	5,509,600	5,520,000									
準備預金残		4,738,600	4,774,900	4,832,900	4,841,900	4,843,300									
マネタリーベース		6,680,100	6,704,500	6,777,100	6,767,900	6,779,200									
無担O/N加重平均		▲0.061%	▲0.064%	▲0.069%	▲0.072%	▲0.073%									
コール市場残高		176,238	174,386	176,656	175,017	174,080									
うち無担		148,467	147,657	148,726	147,577	145,309									
うちO/N		77,865	75,600	75,619	74,015	70,722									
うち有担		27,771	26,729	27,930	27,440	28,771									

●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)
国庫短期証券	1165	-	63,000	2023/6/26	2023/9/25	126,562.1	51,062.7	100.0285	▲0.1142%	37.0659%	100.0328	▲0.1315%	11,937.0

●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		2023/6/26		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		2023/6/26		0.315	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/6/26			6,218	4,251	▲0.008		▲0.006	89.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/6/26			6,760	4,502	▲0.011		▲0.007	84.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/6/26			9,200	5,753	▲0.002		0.001	50.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/6/26			4,265	2,005	0.000		0.002	34.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/23	2023/6/26	▲0.350	31,441	31,441		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/23	2023/6/26	▲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26日の予定

*決定会合における主な意見(6月15・16日分)	*5月の企業向けサービス価格指数	*4月の景気動向指数改訂状況
--------------------------	------------------	----------------

◆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