

# Central Daily Market Report

2023年6月26日(月)  
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26日 需給速報	2023年6月27日 需給予想	2023年6月28日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 1,000	▲ 500			
財政	8,400	0	▲ 12,000			
資金過不足	8,300	▲ 1,000	▲ 12,500			
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						
国債買入	16,800					
CP等買入		▲ 300		▲ 100		
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	▲ 38,700	31,500		38,700		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	17,500	37,600	▲ 12,500			
当座預金残高	5,519,600	5,557,200	5,544,700			
準備預金残高	4,864,700					
積み終了先	4,862,700			6月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,862,700			積数	13,800	
非準備預金先	654,900			1日平均	700	
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	99.64%	日数	36.67%		

## ●2023年6月26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▲0.080~▲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>

26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

2023/6/26	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	前日比	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	▲ 0.075					-	▲ 0.084	0.350	▲ 0.015	32,698.81	▲ 82.73	143.53-55	143.18-20
T/N								-	▲ 0.086						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.075					-	▲ 0.119						
2W	▲ 0.070	0.010	▲ 0.061					-	▲ 0.122						
3W			▲ 0.070					-	▲ 0.128						
1M			0.130					-	▲ 0.132						
3M								▲ 0.122	▲ 0.142						
6M								▲ 0.170	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
										日付	6/19	6/20	6/21	6/22	6/23
										日銀当預残	5,447,600	5,519,500	5,509,600	5,520,000	5,502,100
										準備預金残	4,774,900	4,832,900	4,841,900	4,843,300	4,843,500
										マネタリーベース	6,704,500	6,777,100	6,767,900	6,779,200	6,762,000
										無担O/N加重平均	▲ 0.064%	▲ 0.069%	▲ 0.072%	▲ 0.073%	▲ 0.074%
										コール市場残高	174,386	176,656	175,017	174,080	175,622
										うち無担	147,657	148,726	147,577	145,309	146,849
										うちO/N	75,600	75,619	74,015	70,722	71,961
										うち有担	26,729	27,930	27,440	28,771	28,773

## ●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		2023/6/27		0.135	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		2023/6/27		0.316	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/26	2023/6/27	▲ 0.350	38,616	38,616		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/26	2023/6/27	▲ 0.350	53	53		▲ 0.350	▲ 0.350	

\*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27日の予定

*1-3月期の資金循環統計速報	*5月の米耐久財新規受注 *4月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 *5月の米新築一戸建て販売件数 *6月の米CB消費者信頼感指数	*20年利付国債入札 (12,000億円、6/28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