

# Central Daily Market Report

2023年6月27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27日 需給速報	2023年6月28日 需給予想	2023年6月29日 当社予想			
銀行券	▲ 1,000	▲ 400	▲ 1,000			
財政	▲ 1,200	▲ 19,500	8,000			
資金過不足	▲ 2,200	▲ 19,900	7,000			
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			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
新型コロナウイルス感染症支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 37,500	38,700		37,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 1,100	18,300	7,000			
当座預金残高	5,518,500	5,536,800	5,543,800			
準備預金残高	4,870,000					
積み終了先	4,868,100			6月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,868,100			積数	11,900	
非準備預金先				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	99.69%	日数	40.00%		

## ●2023年6月27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>

27日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱めの結果となった。マーケットで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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏であった。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.000%、平均レート+0.014%と、前回(按分▲0.007%、平均+0.006%)比で、按分、平均ともに上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/6/27	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	▲ 0.074					-	▲ 0.085	0.370	0.020	32,538.33	▲ 160.48	143.46-49	143.51-53
T/N								-	▲ 0.086						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.115						
2W								-	▲ 0.117						
3W				0.150				-	▲ 0.126						
1M								-	▲ 0.126						
3M								▲ 0.115	▲ 0.136						
6M								▲ 0.146	▲ 0.132						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		6/20	6/21	6/22	6/23	6/26									
日銀当預残	5,519,500	5,509,600	5,520,000	5,502,100	5,519,600										
準備預金残	4,832,900	4,841,900	4,843,300	4,843,500	4,864,700										
マネタリーベース	6,777,100	6,767,900	6,779,200	6,762,000	6,779,600										
無担O/N加重平均	▲0.069%	▲0.072%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.075%										
コール市場残高	176,656	175,017	174,080	175,622	168,479										
うち無担	148,726	147,577	145,309	146,849	138,042										
うちO/N	75,619	74,015	70,722	71,961	64,314										
うち有担	27,930	27,440	28,771	28,773	30,437										

## ●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I非価格 競争入札(億円)
20年利付国債	184	1.100%	12,000	2023/6/28	2043/3/20	29,837.0	9,863.00	102,3000	0.9610%	66.8627%	102.5200	0.9480%	2,132.0

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/6/28			7,854	1,000	0.023		0.024	33.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/6/28		0.150	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		2023/6/28		0.339	0	0				
米ドル資金供給		2023/6/29	2023/7/7	5.330	1	1				
CP等買入	4,000	2023/6/30			7,218	3,996	0.000		0.014	59.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/27	2023/6/28	▲0.350	37,390	37,390		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/27	2023/6/28	▲0.350	35	35		▲0.350	▲0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/6/28	2023/7/10		2	2		▲0.100	▲0.100	

\*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28日の予定

\*特にありません

◆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