

Central Daily Market Report

2023年6月29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29日 需給速報	2023年6月30日 需給予想	2023年7月3日 当社予想			
銀行券	▲ 300	0	500			
財政	▲ 400	3,800	▲ 35,000			
資金過不足	▲ 700	3,800	▲ 34,500			
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						
CP等買入	▲ 700	4,000	▲ 3,300			
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対応金融支援特別 気候変動対応オペ				▲ 51,900		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 41,000	39,500	41,000			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当増増減	▲ 2,900	▲ 6,400	▲ 34,500			
当座預金残高	5,494,600	5,488,200	5,453,700			
準備預金残高	4,831,400					
積み終了先	4,830,200			6月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,830,200			積数	8,900	
非準備預金先	663,200			1日平均	600	
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	99.77%	日数	46.67%		

●2023年6月29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▲0.08~▲0.077%程度での出合いが中心となり、一巡後も同水準で散発的な出合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%程度での出合いとなった。四半期末過ぎとなった事で警戒感もあったが、投資家・業者の売りが優勢となった事で、前日から横ばい圏での推移となった。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>

29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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/6/29	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.075				-	▲ 0.085	0.380	▲ 0.005	33,234.14	40.15	144.39-41	144.31-33
T/N							-	▲ 0.086						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.073	▲ 0.015	▲ 0.071				-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.072	▲ 0.010	▲ 0.063				-	▲ 0.112						
3W							-	▲ 0.120						
1M			▲ 0.025				-	▲ 0.122						
3M			0.030				▲ 0.121	▲ 0.131						
6M			0.010				▲ 0.140	▲ 0.132						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		6/22	6/23	6/26	6/27	6/28								
日銀当預残	5,520,000	5,502,100	5,519,600	5,518,500	5,497,500									
準備預金残	4,843,300	4,843,500	4,864,700	4,870,000	4,848,500									
マネタリーベース	6,779,200	6,762,000	6,779,600	6,779,500	6,758,900									
無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.074%	▲0.075%	▲0.074%	▲0.076%									
コール市場残高	174,080	175,622	168,479	172,820	173,090									
うち無担	145,309	146,849	138,042	143,641	142,596									
うちO/N	70,722	71,961	64,314	69,541	69,846									
うち有担	28,771	28,773	30,437	29,179	30,494									

●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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
2年利付国債	450	0.005%	29,000	2023/7/3	2025/7/1	100,529.0	23,580.00	100.1300	▲0.0600%	32.4884%	100.1350	▲0.0620%	5,412.0	-

●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		2023/6/30		0.115	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		2023/6/30		0.300	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/29	2023/6/30	▲0.350	40,956	40,956		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/29	2023/6/30	▲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30日の予定

*5月の完全失業率(市場予想:2.6%)	*5月の米個人所得・消費支出	*国庫短期証券(1166回)入札(3ヶ月、63,000億円、7/3発行)
*5月の有効求人倍率(市場予想:1.32倍)	*6月のシカゴPM景況感指数	
*6月の都区部消費者物価指数(GPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.3%)	*6月のユーロ圏消費者物価指数速報値	
*5月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲1.0%)	*1-3月期の英GDP確報値	
*5月の住宅着工統計		

◆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。

◆本資料は何ら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たい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