

Central Daily Market Report

2023年6月30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30日 需給速報	2023年7月3日 需給予想	2023年7月4日 当社予想			
銀行券	100	200	1,000			
財政	4,100	▲ 36,800	▲ 33,000			
資金過不足	4,200	▲ 36,600	▲ 32,000			
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			14,100			
CP等買入	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	▲ 44,100	41,000	44,100			
※ドル資金供給用担保債供給						
当増増減	▲ 50,100	21,600	▲ 32,000			
当座預金残高	5,444,500	5,466,100	5,434,100			
準備預金残高	4,767,200					
積み終了先	4,767,000			7月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,764,900			積数	2,100	
非準備預金先	677,300			1日平均	200	
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	99.95%	日数	56.67%		

●2023年6月30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%前後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、四半期末日となった事もあり閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.08%程度での出合いとなった。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>

30日はTB3M物(第1166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、小じっかりと推移した。

<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

2023/6/30	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	▲ 0.077				-	▲ 0.084	0.395	0.015	33,189.04	▲ 45.10	144.79-80	144.84-86
T/N								-	▲ 0.085						
S/N								-	-						
1W				▲ 0.068				-	▲ 0.104						
2W		▲ 0.067	▲ 0.005	▲ 0.039				-	▲ 0.109						
3W								-	▲ 0.117						
1M								-	▲ 0.122						
3M				0.150				▲ 0.131	▲ 0.133						
6M								▲ 0.140	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		6/23	6/26	6/27	6/28	6/29									
日銀当預残		5,502,100	5,519,600	5,518,500	5,497,500	5,494,600									
準備預金残		4,843,500	4,864,700	4,870,000	4,848,500	4,831,600									
マネタリーベース		6,762,000	6,779,600	6,779,500	6,758,900	6,756,300									
無担O/N加重平均		▲0.074%	▲0.075%	▲0.074%	▲0.076%	▲0.075%									
コール市場残高		175,622	168,479	172,820	173,090	174,678									
うち無担		146,849	138,042	143,641	142,596	144,075									
うちO/N		71,961	64,314	69,541	69,846	73,525									
うち有担		28,773	30,437	29,179	30,494	30,603									

●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1166	-	63,000	2023/7/3	2023/10/2	148,783.0	51,302.4	100.0290	▲0.1162%	61.0434%	100.0320	▲0.1283%	11,697.0

●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		2023/7/3		0.120	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		2023/7/3		0.305	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,500	2023/7/3			10,229	4,502	▲0.003		▲0.002	70.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/7/3			8,735	5,754	0.006		0.010	50.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/7/3			4,318	2,001	0.017		0.019	27.1
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/7/3			2,877	1,006	0.027		0.030	71.2
国債買入(物価連動債)	600	2023/7/3			2,199	600	▲0.340		▲0.360	50.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/30	2023/7/3	▲0.350	44,077	44,077		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/30	2023/7/3	▲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7月3日の予定

*6月調査の日銀短観(概要及び要旨) (市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI)+3)	*6月のISM製造業景況指数 *5月の米建設支出
---	-----------------------------

◆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