

# Central Daily Market Report

2023年5月16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5月16日 需給速報	2023年5月17日 需給予想	2023年5月18日 当社予想			
銀行券	1,400	400	▲ 500			
財政	▲ 27,100	▲ 2,100	▲ 13,000			
資金過不足	▲ 25,700	▲ 1,700	▲ 13,500			
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						
国庫短期証券買入			1,000			
国債買入						
CP等買入	4,000	▲ 200	▲ 500			
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対策特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 29,700	28,600	29,700			
※ドル資金供給用担保提供額						
当増減	▲ 23,000	28,500	▲ 13,500			
当座預金残高	5,427,600	5,456,100	5,442,600			
準備預金残高	4,739,300					
積み終了先	3,021,600			5月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,235,400			積数	504,700	
非準備預金先	688,300			1日平均	16,800	
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額					4,008,700	
準備預金進捗率	実績	87.41%	日数	3.23%		

## ●2023年5月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み初日となった事でレート目線が定まりづらい中、国内勢の調達を中心に▲0.04~▲0.03%近辺の出合いが始まった。ターム物のレート水準を足掛かりとし、地銀業態からは▲0.03%近辺、大手行からはその水準よりも低い▲0.05~▲0.04%近辺でビッドが多く見られた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.085%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>

16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、無難な結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出合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

2023/5/16	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.034					-	▲ 0.091	0.390	▲ 0.015	29,842.99	216.65	136.03-05	135.79-81
T/N								-	▲ 0.097						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.044	0.008	▲ 0.041					-	▲ 0.124						
2W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.044					-	▲ 0.132						
3W								-	▲ 0.142						
1M	▲ 0.030	▲ 0.009	▲ 0.023					-	▲ 0.149						
3M			0.010					▲ 0.175	▲ 0.157						
6M								▲ 0.175	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.162	▲ 0.102						
日付		5/9	5/10	5/11	5/12	5/15									
日銀当預残	5,483,600	5,453,400	5,452,700	5,439,300	5,450,600										
準備預金残	4,798,500	4,778,700	4,763,900	4,770,900	4,833,900										
マネタリーベース	6,754,700	6,722,000	6,720,100	6,705,100	6,714,900										
無担O/N加重平均	▲0.070%	▲0.061%	▲0.046%	▲0.030%	▲0.023%										
コール市場残高	179,426	189,497	186,666	182,638	174,129										
うち無担	154,773	162,548	160,069	155,390	145,485										
うちO/N	85,300	93,565	89,736	87,127	77,572										
うち有担	24,653	26,949	26,597	27,248	28,644										

## ●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	募入最高利率・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利率・利回較差	第1非償還入札(億円)	非競争入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2023/5/23	2023/11/22	496,187.0	13,000.05		0.0000%	2.6200%		0.0000%		-

## ●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	2023/5/17			7,773	1,001	0.005		0.005	55.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/17		0.095	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		2023/5/17		0.290	0	0				
米ドル資金供給		2023/5/18	2023/5/25	5.320	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/16	2023/5/17	▲0.350	29,729	29,729		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/16	2023/5/17	▲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359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5月17日の予定

*1-3月期のGDP 1次速報	*4月の米住宅着工件数	*20年利付国債入札(12,000億円、5/18発行)
	*4月のユーロ圏消費者物価指数改定値	

◆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