

Central Daily Market Report

2023年5月17日(水)
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17日 需給速報	2023年5月18日 需給予想	2023年5月19日 当社予想			
銀行券	500	200	1,000			
財政	▲ 2,200	▲ 10,900	▲ 2,000			
資金過不足	▲ 1,700	▲ 10,700	▲ 1,000			
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		▲ 500	▲ 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						
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						
国債補完供給	▲ 25,500	29,700	25,500			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	3,000	14,700	▲ 1,000			
当座預金残高	5,430,600	5,445,300	5,444,300			
準備預金残高	4,741,700					
積み終了先	4,661,900			5月18日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,321,600			積数	84,600	
非準備預金先	688,900			1日平均	2,900	
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	97.89%	日数	6.45%		

●2023年5月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.04~▲0.02%近辺の出会いが始まった。大きな変化がなかったことから、レートは前日比で横這いからやや上昇となった。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>

17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

2023/5/17	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	▲ 0.033					-	▲ 0.095	0.360	▲ 0.030	30,093.59	250.60	136.41-44	136.98-99
T/N								-	▲ 0.100						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.025	▲ 0.042					-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.037	▲ 0.005	▲ 0.022					-	▲ 0.134						
3W	▲ 0.038	▲ 0.022	▲ 0.025					-	▲ 0.144						
1M	▲ 0.043	▲ 0.013	▲ 0.029					-	▲ 0.150						
3M								▲ 0.171	▲ 0.156						
6M								▲ 0.175	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.162	▲ 0.102						
日付		5/10	5/11	5/12	5/15	5/16									
日銀当預残		5,453,400	5,452,700	5,439,300	5,450,600	5,427,600									
準備預金残		4,778,700	4,763,900	4,770,900	4,833,900	4,739,400									
マネタリーベース		6,722,000	6,720,100	6,705,100	6,714,900	6,690,500									
無担O/N加重平均		▲0.061%	▲0.046%	▲0.030%	▲0.023%	▲0.034%									
コール市場残高		189,497	186,666	182,638	174,129	183,781									
うち無担		162,548	160,069	155,390	145,485	155,183									
うちO/N		93,565	89,736	87,127	77,572	89,940									
うち有担		26,949	26,597	27,248	28,644	28,598									

●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)
20年利付国債	184	1.100%	12,000	2023/5/18	2043/3/20	35,803.0	9,709.00	101.7500	0.9940%	40.6651%	101.7900	0.9920%	2,282.0

●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		2023/5/18		0.110	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		2023/5/18		0.300	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/17	2023/5/18	▲0.350	25,456	25,456		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/17	2023/5/18	▲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18日の予定

*4月の貿易統計	*4月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1157回)入札 (1年、35,000億円、5/22発行)
		*国有林野借入 (491億円、5/25借入)

◆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