

Central Daily Market Report

2023年5月22日(月)
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22日 需給速報	2023年5月23日 需給予想	2023年5月24日 当社予想			
銀行券	700	600	▲ 500			
財政	▲ 5,100	▲ 4,100	▲ 3,000			
資金過不足	▲ 4,400	▲ 3,500	▲ 3,500			
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						▲ 7,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 400				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			1,000			
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	▲ 28,800	26,100		28,800		
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	▲ 7,500	26,300		▲ 11,400		
当座預金残高	5,430,900	5,457,200		5,445,800		
準備預金残高	4,733,500					
積み終了先	4,729,400			5月23日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,729,400			積数	21,800	
非準備預金先	697,400			1日平均	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	99.46%	日数	22.58%		

●2023年5月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.040~▲0.030%の出合いで始まった。レート水準は前営業日比で概ね横這い圏であったが、週末要因の剥落により落ち着いた取引となった。一巡後も出し手の調整による散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.120~▲0.100%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>

22日のアウトライイト市場は動意に乏しい中、3M物と1Y物で出合いが見られた。

<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

2023/5/22	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	▲ 0.034					-	▲ 0.104	0.380	▲ 0.020	31,086.82	278.47	137.69-71	137.83-85
T/N								-	▲ 0.121						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.045	▲ 0.020	▲ 0.041					-	▲ 0.134						
2W	▲ 0.050	0.001	▲ 0.037					-	▲ 0.144						
3W								-	▲ 0.150						
1M			0.011					-	▲ 0.155						
3M	0.004	0.015	0.007					▲ 0.170	▲ 0.161						
6M								▲ 0.175	▲ 0.133						
1Y								▲ 0.142	▲ 0.102						
										日付	5/15	5/16	5/17	5/18	5/19
										日銀当預残	5,450,600	5,427,600	5,430,600	5,419,500	5,438,400
										準備預金残	4,833,900	4,739,400	4,741,700	4,724,800	4,728,300
										マネタリーベース	6,714,900	6,690,500	6,693,000	6,681,600	6,699,700
										無担O/N加重平均	▲ 0.023%	▲ 0.034%	▲ 0.033%	▲ 0.034%	▲ 0.031%
										コール市場残高	174,129	183,781	181,801	181,910	190,555
										うち無担	145,485	155,183	155,264	154,278	162,606
										うちO/N	77,572	89,940	88,281	85,595	92,973
										うち有担	28,644	28,598	26,537	27,632	27,949

●入札結果

名称	回数	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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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		2023/5/23		0.100	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		2023/5/23		0.285	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/22	2023/5/23	▲ 0.350	28,854	28,854		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/22	2023/5/23	▲ 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350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23日の予定

*4月の米新築一戸建て販売件数	*10年物価連動国債 (2,500億円、5/24発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、5/31借入)
-----------------	--------------------------------	---------------------------------

◆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