

Central Daily Market Report

2023年5月30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30日 需給速報	2023年5月31日 需給予想	2023年6月1日 当社予想			
銀行券	800	700	▲ 100			
財政	7,000	▲ 1,900	▲ 28,000			
資金過不足	7,800	▲ 1,200	▲ 28,100			
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	14,700					
CP等買入		▲ 300	4,000	▲ 2,300		
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感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 29,800	37,400		29,800		
※1ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	29,800	31,300	▲ 28,100			
当座預金残高	5,473,100	5,504,400	5,476,300			
準備預金残高	4,760,200					
積み終了先	4,759,500			5月31日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,759,500			積数	5,600	
非準備預金先	712,900			1日平均	300	
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	99.86%	日数	48.39%		

●2023年5月30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▲0.07~▲0.05%程度の出合いが始まった。引き続きギブン地合いとなる中、出合い水準は前日から概ね横這い圏での推移となったが、一部の先からは調達意欲の更なる低下も見られた。一巡後は、出し手の調整による散発的な出合いのみ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、▲0.200~▲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>

30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。また、マーケットでは3M物と1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/5/30	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	▲ 0.064					-	▲ 0.147	0.430	▲ 0.005	31,328.16	94.62	140.46-47	140.25-27
T/N								-	▲ 0.163						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.068	▲ 0.060	▲ 0.065					-	▲ 0.167						
2W			▲ 0.002					-	▲ 0.167						
3W								-	▲ 0.167						
1M			▲ 0.025					-	▲ 0.168						
3M								▲ 0.181	▲ 0.166						
6M								▲ 0.175	▲ 0.134						
1Y								▲ 0.157	▲ 0.102						
										日付	5/23	5/24	5/25	5/26	5/29
										日銀当預残	5,429,600	5,426,100	5,458,100	5,465,600	5,443,300
										準備預金残	4,730,300	4,731,100	4,755,500	4,775,500	4,737,600
										マネタリーベース	6,689,700	6,686,100	6,718,300	6,725,900	6,703,100
										無担O/N加重平均	▲0.037%	▲0.047%	▲0.059%	▲0.063%	▲0.062%
										コール市場残高	191,231	192,173	191,968	193,192	186,377
										うち無担	164,353	166,315	167,871	167,263	162,964
										うちO/N	93,260	93,822	92,138	92,380	87,391
										うち有担	26,878	25,858	24,097	25,929	23,413

●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)
2年利付国債	449	0.005%	29,000	2023/6/1	2025/6/1	88,443.0	23,469.00	100.1200	▲0.0540%	79.0246%	100.1270	▲0.0580%	5,526.0

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/5/31			6,430	1,000	0.004		0.004	99.7
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/31		0.065	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		2023/5/31		0.260	0	0				
米ドル資金供給		2023/6/1	2023/6/8	5.330	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/30	2023/5/31	▲0.450	29,713	29,713		▲0.450	▲0.451	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/30	2023/5/31	▲0.450	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31日の予定

*4月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+1.5%)	*5月のシカゴPM景況感指数
*4月の商業動態統計速報	*4月の住宅着工統計
*5月の消費動向調査	*米ページブック

◆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