

# Central Daily Market Report

2023年6月5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6月5日 需給速報	2023年6月6日 需給予想	2023年6月7日 当社予想			
銀行券	700	1,100	300			
財政	▲ 4,600	▲ 4,200	▲ 9,000			
資金過不足	▲ 3,900	▲ 3,100	▲ 8,700			
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						▲ 7,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,300					
CP等買入		▲ 300		▲ 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				▲ 400		
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 34,100	34,100		34,100		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	8,100	30,200		▲ 16,400		
当座預金残高	5,344,300	5,374,500		5,358,100		
準備預金残高	4,652,300					
積み終了先	4,651,900			6月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,651,900			積数	2,700	
非準備預金先	692,000			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	99.93%		日数	67.74%	

## ●2023年6月5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▲0.07~▲0.05%程度の出合いで始まった。運用サイドの一部でニーズの減退が見られた一方で、ビッドサイドからは堅調な調達意欲が見られたため、出合い水準は前営業日対比で上昇となった。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は終了した。ターム物はショートターム物での引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.11~▲0.09%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>

5日のアウトライト市場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

2023/6/5	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	▲ 0.068					-	▲ 0.098	0.430	0.020	32,217.43	693.21	140.20-22	140.40-42
T/N								-	▲ 0.102						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.030	▲ 0.062					-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.065	0.030	▲ 0.047					-	▲ 0.140						
3W								-	▲ 0.148						
1M			0.005					-	▲ 0.175						
3M								▲ 0.185	▲ 0.161						
6M								▲ 0.180	▲ 0.134						
1Y								▲ 0.162	▲ 0.102						
										日付	5/29	5/30	5/31	6/1	6/2
										日銀当預残	5,443,300	5,473,100	5,464,500	5,400,300	5,336,200
										準備預金残	4,737,600	4,760,200	4,760,700	4,693,600	4,637,100
										マネタリーベース	6,703,100	6,732,200	6,722,800	6,658,500	6,593,700
										無担O/N加重平均	▲0.062%	▲0.064%	▲0.071%	▲0.070%	▲0.072%
										コール市場残高	186,377	194,596	183,725	188,542	190,756
										うち無担	162,964	170,952	159,567	165,556	166,029
										うちO/N	87,391	94,899	91,524	89,193	85,846
										うち有担	23,413	23,644	24,158	22,986	24,727

## ●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	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		2023/6/6		0.090	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		2023/6/6		0.295	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/6/6		0.265	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/5	2023/6/6	▲0.350	33,926	33,926		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/5	2023/6/6	▲0.350	84	84		▲0.350	▲0.350	

\*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。※3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6月6日の予定

*4月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比▲2.3%)	*30年利付国債入札 (9,000億円、6/7発行)
*4月の毎月勤労統計調査速報	*交付税特別会計借入 (13,000億円、6/15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