

Central Daily Market Report

2023年6月15日(木)

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15日 需給速報	2023年6月16日 需給予想	2023年6月19日 当社予想			
銀行券	▲ 600	100	▲ 500			
財政	79,800	8,300	5,000			
資金過不足	79,200	8,400	4,500			
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						
国庫短期証買入						
国債買入		13,100				
CP等買入	▲ 600		▲ 300			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						▲ 28,000
被災地支援 社債等買入		▲ 100				
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						
国債補充供給	▲ 37,000	36,500		37,000		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当増増減	78,000	58,200		▲ 23,500		
当座預金残高	5,405,100	5,463,300		5,439,800		
準備預金残高	4,754,500					
積み終了先	4,754,500			6月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,754,500			積数	3,883,300	
非準備預金先	650,600			1日平均	129,400	
積み期間(6/16~7/15)の所要準備額					3,883,300	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2023年6月15日の市場動向

<インターバンク市場>

積み最終日となった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▲0.08~▲0.06%程度での出会いとなった。ビッドサイドのレートは低位で始まったものの、最終調整ニーズから、レートは徐々に上昇し、▲0.075%近辺では多くの出会いが見られた。一巡後もビッドが残り、最終的には▲0.06%台での出会いも散見された。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、▲0.110~▲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>

15日はTB3M物(第1163回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、小甘く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

●2023年6月16日の予定

- *日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- *植田日銀総裁定例会見
- *4月の石油等消費動態統計
- *6月のミシガン大消費者信頼感指数速報
- *5月のユーロ圏消費者物価指数改定値

●短期金融市場関連指標

2023/6/15	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	売買参考統計値	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	▲ 0.070					-	▲ 0.094	0.425	0.000	33,485.49	▲ 16.93	139.95-97	141.28-30
T/N								-	▲ 0.102						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.065	0.008	▲ 0.049					-	▲ 0.122						
2W	▲ 0.070	▲ 0.005	▲ 0.051					-	▲ 0.131						
3W								-	▲ 0.164						
1M	▲ 0.070	0.001	▲ 0.047					-	▲ 0.159						
3M			0.011					▲ 0.141	▲ 0.165						
6M								▲ 0.170	▲ 0.135						
1Y								▲ 0.170	▲ 0.101						
日付		6/8	6/9	6/12	6/13	6/14									
日銀当預残	5,333,100	5,321,600	5,335,700	5,331,000	5,327,100										
準備預金残	4,694,000	4,671,000	4,714,900	4,676,300	4,652,700										
マネタリーベース	6,588,800	6,576,800	6,590,800	6,586,100	6,582,800										
無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.028%	▲ 0.058%	▲ 0.079%	▲ 0.078%										
コール市場残高	188,920	197,115	193,158	182,485	187,638										
うち無担	163,844	171,264	166,488	155,103	160,919										
うちO/N	91,921	100,541	94,835	80,130	85,376										
うち有担	25,076	25,851	26,670	27,382	26,719										

●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	素分率	募入平均価格	募入平均利回/利回較差	第1非償債競争入札(億円)
国庫短期証券	1163	-	63,000	2023/6/19	2023/9/19	120,186.0	51,062.7	100.0330	▲0.1308%	70.1891%	100.0385	▲0.1526%	11,937.0

●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		2023/6/16		0.075	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		2023/6/16		0.290	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		2023/6/16		0.260	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/6/16			11,299	4,254	0.005		0.006	52.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/6/16			13,032	5,755	▲0.003		▲0.002	99.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/6/16			4,013	2,003	▲0.004		▲0.001	38.9
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/6/16			2,077	1,007	0.010		0.011	76.1
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オファー分))		2023/6/15	2023/6/16	▲0.350	36,770	36,770		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先・即日(午後オファー分))		2023/6/15	2023/6/16	▲0.350	300	300		▲0.350	▲0.350	

*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。※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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2023/6/19	2027/6/18	0	59,459

◆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