

Central Daily Market Report

2023年6月16日(金)

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16日 需給速報	2023年6月19日 需給予想	2023年6月20日 当社予想	
銀行券	100	▲ 700	▲ 1,000	
財政	7,900	▲ 6,000	75,000	
資金過不足	8,000	▲ 6,700	74,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出				
全店共通				
国債買現				
国債売現				
国庫短期証券買入				
国債買入	13,100			
CP等買入		▲ 200		
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)		59,500	▲ 26,800	
被災地支援				
社債等買入			▲ 700	
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				
国債補充供給	▲ 39,000	37,000	39,000	
※下月資金供給用国債供給				
当増増減	18,800	64,100	74,000	
当座預金残高	5,423,900	5,488,000	5,562,000	
準備預金残高	4,738,600			
積み終了先	4,723,300			
超過準備	3,460,000			
非準備預金先	685,300			
6月19日以降の残り所要積立額				
積数			47,700	
1日平均			1,800	
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	98.77%	日数	10.00%

●2023年6月16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~▲0.055%程度での出会いとなった。週末3日積みとなったものの、積み初日もあった事から、ビッドサイドに慎重な姿勢を取った先も多く、取り上がる動きは見られず▲0.06%前後での出会いが中心となった。一巡後は、レート水準がやや低下し▲0.07%台で散発的な出会いが見られた。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、▲0.095~▲0.080%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>

16日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

<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。

●入札結果

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。

●2023年6月19日の予定

*New York祝日 (Juneteenth National Independence Day)

*国庫短期証券(1164回)入札 (1年、35,000億円、6/20発行)

●短期金融市場関連指標

2023/6/16	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート 平均値	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均			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	▲ 0.061				-	▲ 0.091	0.400	▲ 0.025	33,706.08	220.59	140.26-28	141.14-16
T/N							-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.065	▲ 0.038	▲ 0.045				-	▲ 0.113						
2W	▲ 0.060	▲ 0.010	▲ 0.053				-	▲ 0.157						
3W							-	▲ 0.159						
1M			▲ 0.065				-	▲ 0.155						
3M							▲ 0.145	▲ 0.158						
6M							▲ 0.170	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.170	▲ 0.102						
日付	6/9	6/12	6/13	6/14	6/15									
日銀当預残	5,321,600	5,335,700	5,331,000	5,327,100	5,405,100									
準備預金残	4,671,000	4,714,900	4,676,300	4,652,700	4,754,500									
マネタリーベース	6,576,800	6,590,800	6,586,100	6,582,800	6,661,400									
無担O/N加重平均	▲ 0.028%	▲ 0.058%	▲ 0.079%	▲ 0.078%	▲ 0.070%									
コール市場残高	197,115	193,158	182,485	187,638	189,071									
うち無担	171,264	166,488	155,103	160,919	161,408									
うちO/N	100,541	94,835	80,130	85,376	88,215									
うち有担	25,851	26,670	27,382	26,719	27,663									

●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)	貸付レート ・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	換分 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		2023/6/19		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		2023/6/19		0.285	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		2023/6/19		0.255	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(国債売現先)・即日(午前オフア一分)		2023/6/16	2023/6/19	▲0.350	39,079	39,079		▲0.350	▲0.351	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※4		2023/6/19		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)※5		2023/6/19		0.285	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※6		2023/6/19		0.255	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア一分)		2023/6/16	2023/6/19	▲0.350	0	0				

●日銀政策決定会合・結果

- 当面の金融政策運営について
- 1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。
 - (1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール) (全員一致)
 - ① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。
 - 短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
 - 長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
 - ② 長短金利操作の運用
 - 長期金利の変動幅を「±0.5%程度」とし、10年物国債金利について0.5%の利回りでの指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。
 - 上記の金融市場調節方針と整合的なイールドカーブの形成を促すため、大規模な国債買入れを継続するとともに、各年限において、機動的に、買入れ額の増額や指値オペを実施する。
- (2) 資産買入れ方針 (全員一致)
 - 長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
 - ① E T FおよびJ-R E I Tについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
 - ② C P等は、約2兆円の残高を維持する。社債等は、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(約3兆円)へと徐々に戻していく。
 - ただし、社債等の買入れ残高の調整は、社債の発行環境に十分配慮して進めることとする。

◆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