

# Central Daily Market Report

2023年6月21日(水)

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21日 需給速報	2023年6月22日 需給予想	2023年6月23日 当社予想			
銀行券	▲ 700	▲ 900	▲ 1,000			
財政	▲ 8,700	6,900	▲ 18,000			
資金過不足	▲ 9,400	6,000	▲ 19,000			
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	8,900	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 200	▲ 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			1,000			
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	▲ 37,400	36,200	37,400			
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	▲ 9,900	45,100	▲ 19,000			
当座預金残高	5,509,600	5,554,700	5,535,700			
準備預金残高	4,841,900					
積み終了先	4,838,300			6月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,837,300			積数	23,900	
非準備預金先	667,700			1日平均	1,000	
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	99.38%	日数	20.00%		

## ●2023年6月21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、引き続きビッドサイドの幅広い業態からレートを引き下げる動きが見られたため、出会い水準は前日に比べ低下した。朝方は邦銀業態からの調達を中心に▲0.08~▲0.07%程度での出会いとなり、一巡後も大きな変化は無く、同水準で散発的な出会いが見られた程度となった。  
ターム物は、月内エンドの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、▲0.090~▲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>

21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、やや弱めの結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートに目立った変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/6/21	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	
	単位：%	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)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.072				-	▲ 0.089	0.370	▲ 0.015	33,575.14	186.23	141.33-35	142.08-10
T/N							-	▲ 0.091						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.040	▲ 0.062				-	▲ 0.108						
2W							-	▲ 0.147						
3W							-	▲ 0.144						
1M							-	▲ 0.145						
3M			0.023				▲ 0.148	▲ 0.153						
6M							▲ 0.170	▲ 0.134						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		6/14	6/15	6/16	6/19	6/20								
日銀当預残		5,327,100	5,405,100	5,423,900	5,447,600	5,519,500								
準備預金残		4,652,700	4,754,500	4,738,600	4,774,900	4,832,900								
マネタリーベース		6,582,800	6,661,400	6,680,100	6,704,500	6,777,100								
無担O/N加重平均		▲0.078%	▲0.070%	▲0.061%	▲0.064%	▲0.069%								
コール市場残高		187,638	189,071	176,238	174,386	176,656								
うち無担		160,919	161,408	148,467	147,657	148,726								
うちO/N		85,376	88,215	77,865	75,600	75,619								
うち有担		26,719	27,663	27,771	26,729	27,930								

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/6/22			8,516	1,001	0.016		0.016	76.6
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/6/22		0.115	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		2023/6/22		0.295	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/21	2023/6/22	▲0.350	37,273	37,273		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/21	2023/6/22	▲0.350	167	167		▲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22日の予定

*月例経済報告	*英中銀MPC結果発表	*5年利付国債入札
*沖縄県金融経済懇談会において 野口日銀審議委員講演	*5月の米中古住宅販売	(25,000億円、6/23発行)

◆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