

●資金需給

単位：億円	2023年6月19日 需給速報	2023年6月20日 需給予想	2023年6月21日 当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 700	▲ 1,000
財政	▲ 6,000	71,300	▲ 3,000
資金過不足	▲ 6,600	70,600	▲ 4,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			▲ 8,000
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
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	▲ 1,500
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			
国債補完供給	▲ 40,500	39,000	40,500
米ドル資金供給用担保提供特約			
当預増減	23,700	109,400	▲ 12,000
当座預金残高	5,447,600	5,557,000	5,545,000
準備預金残高	4,774,800		
積み終了先	4,765,900	6月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,762,400	積数	35,300
非準備預金先	672,800	1日平均	1,400
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	99.09%	日数
			13.33%

●短期金融市場関連指標

2023/6/19	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.088
T/N							-	▲ 0.091
S/N							-	-
1W	▲ 0.070	▲ 0.050	▲ 0.067				-	▲ 0.113
2W							-	▲ 0.156
3W			0.003				-	▲ 0.151
1M							-	▲ 0.151
3M			0.025				▲ 0.148	▲ 0.154
6M							▲ 0.170	▲ 0.133
1Y							▲ 0.148	▲ 0.102

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.390	▲ 0.010	33,370.42	▲ 335.66	141.85-87	141.84-85
日付	6/12	6/13	6/14	6/15	6/16
日銀当預残	5,335,700	5,331,000	5,327,100	5,405,100	5,423,900
準備預金残	4,714,900	4,676,300	4,652,700	4,754,500	4,738,600
マネタリーベース	6,590,800	6,586,100	6,582,800	6,661,400	6,680,100
無担O/N加重平均	▲ 0.058%	▲ 0.079%	▲ 0.078%	▲ 0.070%	▲ 0.061%
コール市場残高	193,158	182,485	187,638	189,071	176,238
うち無担	166,488	155,103	160,919	161,408	148,467
うちO/N	94,835	80,130	85,376	88,215	77,865
うち有担	26,670	27,382	26,719	27,663	27,771

●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)
国庫短期証券	1164	-	35,000	2023/6/20	2024/6/20	105,208.0	30,030.7	100.1290	▲ 0.1284%	67.3784%	100.1300	▲ 0.1294%	4,969.0

●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		2023/6/20		0.100	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		2023/6/20		0.305	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		2023/6/20		0.275	0	0				
社債等買入	1,000	2023/6/22			2,340	1,002	0.220		0.259	85.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/6/19	2023/6/20	▲ 0.350	40,510	40,510		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/6/19	2023/6/20	▲ 0.350	12	12		▲ 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20日の予定

*5月の米住宅着工件数

◆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。
◆本資料は何ら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

●2023年6月19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、週末要因の剥落により、先週末に比べ若干低い水準での取引が中心となった。朝方は邦銀業態からの調達を中心に▲0.07～▲0.06%程度での出会いとなり、一巡後も大きな変化は無く▲0.07%前後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～▲0.080%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＞

19日はTB1Y物(第1164回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、しっかり推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は複数の入札が実施され、発行レートは、概ね横ばい圏で推移し、目立った変動は見られなかった。