

Central Daily Market Report

2023年4月3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4月3日 需給速報	2023年4月4日 需給予想	2023年4月5日 当社予想			
銀行券	600	800	1,000			
財政	▲ 30,400	▲ 14,100	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 29,800	▲ 13,300	▲ 26,000			
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						▲ 8,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 100				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
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	▲ 51,300	51,900	53,100			
※1ドル資金供給用担保提供増減						
当増増減	▲ 29,300	39,800	▲ 34,500			
当座預金残高	5,461,500	5,501,300	5,466,800			
準備預金残高	4,758,600					
積み終了先	4,758,500			4月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,758,500			積数	700	
非準備預金先	702,900			1日平均	100	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額						3,909,200
準備預金進捗率	実績	99.98%	日数	61.29%		

●2023年4月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.01~▲0.005%近辺での出合いとなった。年度末要因の剥落により調達を再開する先が増加した事で、ビッドサイドの厚みが増しレート水準は大きく上昇した。出合い一巡後は、ビッド水準がやや低下したものの調達ニーズは根強く、▲0.02~▲0.01%台で散発的な出合いが見られた。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.15~▲0.095%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>

3日はTB3M物(第1148回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、強含みで推移した。

<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

2023/4/3	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.130	0.365	0.045	28,188.15	146.67	133.35~37	133.53~55
T/N			▲ 0.001					-	▲ 0.137						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.023	0.001	▲ 0.010					-	▲ 0.141						
2W	▲ 0.020	▲ 0.003	▲ 0.011					-	▲ 0.146						
3W			0.035					-	▲ 0.152						
1M	▲ 0.010	0.000	▲ 0.007					-	▲ 0.167						
3M			0.000					▲ 0.195	▲ 0.174						
6M								▲ 0.160	▲ 0.128						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.098						
日付		3/27	3/28	3/29	3/30	3/31									
日銀当預残		5,439,700	5,463,400	5,465,700	5,493,700	5,490,800									
準備預金残		4,752,900	4,776,100	4,783,900	4,805,800	4,859,200									
マネタリーベース		6,707,900	6,731,600	6,733,800	6,762,100	6,758,500									
無担O/N加重平均		▲0.014%	▲0.015%	▲0.015%	▲0.014%	▲0.030%									
コール市場残高		197,664	194,961	191,622	196,752	138,582									
うち無担		168,389	166,981	164,754	169,903	117,777									
うちO/N		95,636	93,938	93,013	97,567	69,771									
うち有担		29,275	27,980	26,868	26,849	20,805									

●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	1148	-	63,000	2023/4/4	2023/7/10	172,607.0	51,251.70	100.0420	▲0.1579%	54.7668%	100.0447	▲0.1681%	11,748.0

●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		2023/4/4		0.180	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		2023/4/4		0.270	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/5	2023/4/12	5.070	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/4/3	2023/4/4	▲1.100	2,120	2,120		▲1.100	▲1.560	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/3	2023/4/4	▲0.350	49,067	49,067		▲0.350	▲0.352	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/3	2023/4/4	▲0.350	0	0				

*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369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国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)の売却銘柄は、利付国(10年)第367回(813億円)、368回(1,307億円)です。

●2023年4月4日の予定

*3月のマネタリーベース *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*2月の米製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札 (27,000億円、4/5発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、4/11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