

Central Daily Market Report

2023年4月7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4月7日 需給速報	2023年4月10日 需給予想	2023年4月11日 当社予想	
銀行券	1,200	700	1,000	
財政	▲ 7,600	▲ 7,000	2,000	
資金過不足	▲ 6,400	▲ 6,300	3,000	
金融調節	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				
CP等買入	▲ 200	▲ 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感染症 気候変動対応オペ				
E T F 買入		700		
国債補充供給	▲ 35,300	36,500	36,000	
※ドル資金供給用担保債供給				
当増増減	▲ 5,400	30,300	3,000	
当座預金残高	5,454,700	5,485,000	5,488,000	
準備預金残高	4,755,000			
積み終了先	4,754,900		4月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,754,900		積数	200
非準備預金先	699,700		1日平均	0
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額				3,918,900
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	80.65%

●2023年4月7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▲0.005~▲0.002%近辺での出合いとなった。週末3日積み要因から、ビッドサイドは取り上がる動きを一段と強めた事で、レート水準は昨日対比で更に上昇した。出合い一巡後も、調達ニーズは引き続き根強く、▲0.005%程度で散発的な出合いが見られて本日の取引を終えた。
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~▲0.125%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>

7日はTB3M物(第1150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は、強含みで推移した。この他、6M物でも出合いが見られた。

<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。

●短期金融市場関連指標

2023/4/7	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	
	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	▲ 0.005				-	▲ 0.113	0.455	▲ 0.010	27,518.31	45.68	131.67-69	131.87-90
T/N							-	▲ 0.144						
S/N			0.001				-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.009	▲ 0.010				-	▲ 0.161						
2W	▲ 0.040	0.031	▲ 0.026				-	▲ 0.165						
3W							-	▲ 0.173						
1M			▲ 0.001				-	▲ 0.178						
3M							▲ 0.300	▲ 0.177						
6M							▲ 0.185	▲ 0.132						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.099						
日付	3/31	4/3	4/4	4/5	4/6									
日銀当預残	5,490,800	5,461,500	5,462,300	5,445,300	5,460,100									
準備預金残	4,859,200	4,758,600	4,760,900	4,751,900	4,769,500									
マネタリーベース	6,758,500	6,728,500	6,728,500	6,711,100	6,726,000									
無担O/N加重平均	▲0.030%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.007%	▲0.006%									
コール市場残高	138,582	185,053	187,105	191,006	198,146									
うち無担	117,777	156,211	156,181	160,546	168,640									
うちO/N	69,771	91,410	86,620	90,360	95,604									
うち有担	20,805	28,842	30,924	30,460	29,506									

●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	1150	-	63,000	2023/4/10	2023/7/18	192,645.0	51,251.6	100.0505	▲0.1860%	90.7936%	100.0509	▲0.1875%	11,748.0

●オペ結果

種類	オフア額(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		2023/4/10		0.035	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		2023/4/10		0.215	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/11	2023/4/18	5.070	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)※3		2023/4/7	2023/4/10	▲1.100	837	837		▲1.100	▲1.631	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)		2023/4/7	2023/4/10	▲0.350	34,547	34,547		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフア分)		2023/4/7	2023/4/10	▲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ア。
※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ア。
※3国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフア分)の売却銘柄は、利付国(10年)第368回です。

●2023年4月10日の予定

*2月の国際収支	*2月の米卸売売上高
*2月の特定サービス産業動態統計速報	*2月の米消費者信用残高
*3月の消費動向調査	*EURO、London祝日(Easter Monday)
*3月の景気ウォッチャー調査	

◆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