

Central Daily Market Report

2023年4月14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14日 需給速報	2023年4月17日 需給予想	2023年4月18日 当社予想			
銀行券	▲ 100	400	▲ 1,000			
財政	74,300	7,300	▲ 1,000			
資金過不足	74,200	7,700	▲ 2,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		17,400				
CP等買入	▲ 300		▲ 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			▲ 100			
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	▲ 43,200	45,000		43,200		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	75,700	67,900	▲ 2,000			
当座預金残高	5,489,700	5,557,600	5,555,600			
準備預金残高	4,791,800					
積み終了先	4,791,800			4月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,791,800			積数	386,100	
非準備預金先	697,900			1日平均	13,300	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,846,600	
準備預金進捗率	実績	89.96%	日数	3.33%		

●2023年4月14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。実質的な積み最終日となり、調達量を制限する先も見られたが、レートへの影響は限られ、前日と比べ概ね横這い圏での推移となった。一巡後は、▲0.04~▲0.005%近辺で散発的に出合いが見られて本日の取引を終了した。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、▲0.11~▲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>

14日はTB3M物(第1151回)の入札が実施され、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

<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這い圏であった。

●2023年4月17日の予定

*2月の石油等消費動態統計

●短期金融市場関連指標

2023/4/14	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	売買参考統計値	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	▲ 0.045	0.001	▲ 0.007					-	▲ 0.109	0.455	0.000	28,493.47	336.50	132.49-51	132.21-23
T/N								-	▲ 0.105						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.015					-	▲ 0.127						
2W			▲ 0.010					-	▲ 0.140						
3W			▲ 0.020					-	▲ 0.154						
1M	▲ 0.008	0.100	▲ 0.002					-	▲ 0.157						
3M								▲ 0.182	▲ 0.168						
6M								▲ 0.185	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.099						
日付		4/7	4/10	4/11	4/12	4/13									
日銀当預残	5,454,700	5,429,900	5,443,500	5,416,100	5,414,000										
準備預金残	4,755,000	4,734,000	4,749,100	4,727,500	4,727,300										
マネタリーベース	6,719,400	6,693,800	6,706,900	6,679,300	6,677,800										
無担O/N加重平均	▲0.005%	▲0.006%	▲0.007%	▲0.006%	▲0.006%										
コール市場残高	193,769	194,127	193,670	202,645	202,456										
うち無担	166,245	167,756	168,352	174,445	173,929										
うちO/N	91,559	92,220	92,146	96,479	96,163										
うち有担	27,524	26,371	25,318	28,200	28,527										

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1151	-	63,000	2023/4/17	2023/7/24	168,950.0	51,251.5	100.0450	▲0.1675%	93.4287%	100.0488	▲0.1816%	11,748.0
交付税特会	-	-	13,000	2023/4/24	2023/10/24	506,417.0	13,000.02		0.0000%	2.5671%		0.0000%	

●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)	授分レート・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	授分比率
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/4/17		0.045	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		2023/4/17		0.215	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/4/17			13,298	4,257	0.002		0.003	2.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/4/17			9,141	5,006	▲0.004		▲0.001	21.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/4/17			13,900	6,760	0.000		0.002	25.0
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/4/17			3,335	1,006	0.011		0.011	96.3
国債買入(変動利付債)	300	2023/4/17			315	300	▲0.070		▲1.314	70.0
米ドル資金供給		2023/4/18	2023/4/25	5.070	1	1				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/4/14	2023/4/17	▲1.100	891	891		▲1.100	▲1.320	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/14	2023/4/17	▲0.350	42,457	42,457		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/14	2023/4/17	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/4/17	2023/4/26		2	2		▲0.100	▲0.100	

*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、利付国債(10年)第368回です。

◆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