

Central Daily Market Report

2023年4月18日(火)

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18日 需給速報	2023年4月19日 需給予想	2023年4月20日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 600	▲ 2,000			
財政	4,100	▲ 8,000	5,000			
資金過不足	3,800	▲ 8,600	3,000			
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			10,900	▲ 8,300		
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						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入				▲ 300		
新型コロナウイルス感染症対策特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 37,300	36,100		37,300		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	2,600	32,000	3,000			
当座預金残高	5,524,700	5,556,700	5,559,700			
準備預金残高	4,818,200					
積み終了先	4,805,000			4月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,796,400			積数	46,500	
非準備預金先	706,500			1日平均	1,700	
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	98.79%	日数	10.00%		

●2023年4月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.008~▲0.005%近辺での出会いとなった。一巡後は、レート水準がやや低下し▲0.04~▲0.01%近辺で散発的に出会いが見られた。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、▲0.11~▲0.10%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>

18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、軟調な結果となった。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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/4/18	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	▲ 0.009					-	▲ 0.099	0.470	▲ 0.009	28,658.83	144.05	134.44-46	134.22-24
T/N								-	▲ 0.110						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.018					-	▲ 0.126						
2W	▲ 0.009	▲ 0.005	▲ 0.007					-	▲ 0.142						
3W	▲ 0.015	▲ 0.006	▲ 0.012					-	▲ 0.151						
1M			▲ 0.005					-	▲ 0.154						
3M								▲ 0.170	▲ 0.166						
6M								▲ 0.185	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.099						
日付		4/11	4/12	4/13	4/14	4/17									
日銀当預残	5,443,500	5,416,100	5,414,000	5,489,700	5,522,100										
準備預金残	4,749,100	4,727,500	4,727,300	4,791,800	4,819,600										
マネタリーベース	6,706,900	6,679,300	6,677,800	6,753,600	6,785,500										
無担O/N加重平均	▲ 0.007%	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.007%	▲ 0.010%										
コーポ市場残高	193,670	202,645	202,456	186,054	204,651										
うち無担	168,352	174,445	173,929	160,600	177,295										
うちO/N	92,146	96,479	96,163	87,724	103,719										
うち有担	25,318	28,200	28,527	25,454	27,356										

●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)
流動性供給	380	-	5,000	2023/4/19	-	23,743.0	4,988.0		▲0.009%	25.6892%		▲0.012%	

●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	2023/4/19			8,693	1,000	0.050		0.052	41.3
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/4/19		0.021	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		2023/4/19		0.180	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/20	2023/4/27	5.080	0	0				
社債等買入	1,000	2023/4/21			2,676	1,000	0.254		0.288	73.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/4/18	2023/4/19	▲1.100	882	882		▲1.100	▲1.167	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/18	2023/4/19	▲0.350	36,621	36,621		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/4/19	2023/5/10	0.000	10,895	10,895				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/18	2023/4/19	▲0.350	0	0				

*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国債補完供給(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368回です。

●2023年4月19日の予定

*米ページブック	*国庫短期証券(1152回)入札
*3月のユーロ圏消費者物価指数改定値	(1年、35,000億円、4/20発行)
*3月の英消費者物価指数	

◆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