

# Central Daily Market Report

2023年4月20日(木)

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20日 需給速報	2023年4月21日 需給予想	2023年4月24日 当社予想			
銀行券	▲ 1,300	▲ 600	▲ 1,000			
財政	3,800	▲ 7,700	▲ 3,000			
資金過不足	2,500	▲ 8,300	▲ 4,000			
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						
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			1,000	▲ 300		
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 30,200	29,400		30,200		
※ドル資金供給用担保債提供額						
当預増減	1,500	22,400		▲ 4,000		
当座預金残高	5,529,600	5,552,000		5,548,000		
準備預金残高	4,816,300					
積み終了先	4,811,400			4月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,810,300			積数	30,700	
非準備預金先	713,300			1日平均	1,200	
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	99.20%	日数	16.67%		

## ●2023年4月20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▲0.010~▲0.007%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>

20日のアウトライイト市場は動意なく閑散中、1Y物で出会いが見られた。

### <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

2023/4/20	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	▲ 0.047	0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.099	0.470	0.000	28,657.57	50.81	134.70-72	134.60-62
T/N								-	▲ 0.110						
S/N								-	-						
1W				▲ 0.018				-	▲ 0.124						
2W	▲ 0.040	▲ 0.018	▲ 0.033					-	▲ 0.142						
3W								-	▲ 0.149						
1M	0.011	0.020	0.013					-	▲ 0.154						
3M								▲ 0.165	▲ 0.164						
6M								▲ 0.172	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.147	▲ 0.099						
日付		4/13	4/14	4/17	4/18	4/19									
日銀当預残	5,414,000	5,489,700	5,522,100	5,524,700	5,528,100										
準備預金残	4,727,300	4,791,800	4,819,600	4,818,200	4,817,700										
マネタリーベース	6,677,800	6,753,600	6,785,500	6,788,500	6,792,500										
無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.007%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.010%										
コール市場残高	202,456	186,054	204,651	205,300	208,591										
うち無担	173,929	160,600	177,295	180,461	181,928										
うちO/N	96,163	87,724	103,719	103,325	101,862										
うち有担	28,527	25,454	27,356	24,839	26,663										

## ●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)
20年利付国債	184	1.10%	12,000	2023/4/21	2043/3/20	28,769.0	9,710.0	100.0500	1.0960%	26.6910%	100.2300	1.0850%	2,282.0
交付税特会	-	-	13,000	2023/5/2	2023/11/2	467,490.0	13,000.16		0.0000%	2.7809%		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)	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		2023/4/21		0.030	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		2023/4/21		0.185	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/24	2023/5/1	5.080	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/20	2023/4/21	▲0.350	30,388	30,388		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/20	2023/4/21	▲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。

## ●2023年4月21日の予定

*3月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.1%)	*国庫短期証券(1153回)入札 (3ヶ月、63,000億円、4/24発行)
---	---

◆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