

# Central Daily Market Report

2023年4月25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25日 需給速報	2023年4月26日 需給予想	2023年4月27日 当社予想			
銀行券	▲ 1,600	▲ 1,900	▲ 2,000			
財政	3,900	▲ 17,900	3,000			
資金過不足	2,300	▲ 19,800	1,000			
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		1,000				
国債買入						
CP等買入		▲ 300	▲ 400			
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対応金融支援特別 気候変動対応オペ						▲ 2,500
E T F買入						
国債補完供給	▲ 25,300	25,300	25,300			
※ドル資金供給用国債補完供給						
当預増減	1,700	6,100	▲ 1,500			
当座預金残高	5,554,800	5,560,900	5,559,400			
準備預金残高	4,833,400					
積み終了先	4,831,600			4月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,830,700			積数	13,900	
非準備預金先	721,400			1日平均	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	99.64%	日数	33.33%		

## ●2023年4月25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▲0.03~▲0.015%近辺での出会いが始まった。オファーがやや増加傾向となる中、ビッドサイドの資金調達ニーズが減少した事により、出会い水準も前日比で低下した。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、▲0.12~▲0.105%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>

25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、無難な結果となった。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発行市場は複数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。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート0.003%、平均落札レート0.015%と、前回(按分0.002%・平均0.011%)比で按分・平均ともに上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/4/25	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.019				-	▲ 0.106	0.475	0.010	28,620.07	26.55	134.08-09	134.14-17
T/N							-	▲ 0.120						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.140						
2W	▲ 0.033	▲ 0.018	▲ 0.025				-	▲ 0.145						
3W			▲ 0.020				-	▲ 0.152						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.154						
3M			0.004				▲ 0.185	▲ 0.160						
6M							▲ 0.172	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.147	▲ 0.102						
日付		4/18	4/19	4/20	4/21	4/24								
日銀当預残	5,524,700	5,528,100	5,529,600	5,523,700	5,553,100									
準備預金残	4,818,200	4,817,700	4,816,300	4,816,400	4,842,600									
マネタリーベース	6,788,500	6,792,500	6,795,200	6,790,000	6,820,400									
無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.010%	▲0.013%									
コール市場残高	205,300	208,591	205,035	205,094	206,168									
うち無担	180,461	181,928	178,329	180,408	182,034									
うちO/N	103,325	101,862	97,533	99,862	102,713									
うち有担	24,839	26,663	26,706	24,686	24,134									

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

## ●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	2023/4/26			6,235	1,000		0.008	0.008	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/4/26		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		2023/4/26		0.215	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/27	2023/5/11	5.180	0	0				
CP等買入	4,000	2023/4/28			7,275	3,995	0.003		0.015	63.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/25	2023/4/26	▲0.350	25,473	25,473		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/25	2023/4/26	▲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26日の予定

*3月の米耐久財新規受注	*2年利付国債入札(29,000億円、5/1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