

# Central Daily Market Report

2023年4月26日(水)  
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26日 需給速報	2023年4月27日 需給予想	2023年4月28日 当社予想	
銀行券	▲ 2,000	▲ 2,900	▲ 1,700	
財政	▲ 20,100	2,400	6,200	
資金過不足	▲ 22,100	▲ 500	4,500	
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	1,000			
国債買入				
CP等買入		▲ 400	▲ 200	4,000
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				
国債補充供給	▲ 26,500	25,300	26,500	
※ドル資金供給用担保調達供給				
当預増減	▲ 22,700	23,000	8,500	
当座預金残高	5,532,100	5,555,100	5,563,600	
準備預金残高	4,815,900			
積み終了先	4,814,300		4月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,814,300		積数	12,300
非準備預金先	716,200		1日平均	600
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	99.68%	日数	36.67%

## ●2023年4月26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▲0.035~▲0.025%近辺での出会いが始まった。ビッドサイドの資金調達ニーズが減少する中、出会い水準は前日比で一段と低下する流れとなった。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~▲0.11%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>

26日のアウトライイト市場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発行市場は月末発行にあたり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。

## ●短期金融市場関連指標

2023/4/26	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.031					-	▲ 0.103	0.455	▲ 0.020	28,416.47	▲ 203.60	133.70-72	133.45-47
T/N								-	▲ 0.127						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.030					-	▲ 0.156						
2W	▲ 0.016	0.040	0.009					-	▲ 0.156						
3W								-	▲ 0.158						
1M			0.180					-	▲ 0.162						
3M			0.001					▲ 0.185	▲ 0.161						
6M								▲ 0.172	▲ 0.129						
1Y								▲ 0.147	▲ 0.102						
										日付	4/19	4/20	4/21	4/24	4/25
										日銀当預残	5,528,100	5,529,600	5,523,700	5,553,100	5,554,800
										準備預金残	4,817,700	4,816,300	4,816,400	4,842,600	4,833,400
										マネタリーベース	6,792,500	6,795,200	6,790,000	6,820,400	6,823,700
										無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.009%	▲0.010%	▲0.013%	▲0.019%
										コール市場残高	208,591	205,035	205,094	206,168	206,142
										うち無担	181,928	178,329	180,408	182,034	180,370
										うちO/N	101,862	97,533	99,862	102,713	99,779
										うち有担	26,663	26,706	24,686	24,134	25,772

## ●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)
2年利付国債	448	0.005%	29,000	2023/5/1	2025/5/1	87,797.0	23,700.00	100.0850	▲0.0370%	74.5093%	100.0950	▲0.0420%	5,295.0

## ●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		2023/4/27		0.025	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		2023/4/27		0.210	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/28	2023/5/11	5.180	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/26	2023/4/27	▲0.350	26,689	26,689		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/26	2023/4/27	▲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27日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、28日まで)	*1-3月期の米GDP速報値
------------------------	----------------

◆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