

# Central Daily Market Report

2023年4月27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27日 需給速報	2023年4月28日 需給予想	2023年5月1日 当社予想			
銀行券	▲ 2,900	▲ 1,400	▲ 2,500			
財政	8,500	3,900	▲ 9,000			
資金過不足	5,600	2,500	▲ 11,500			
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		16,400				
CP等買入	▲ 200	4,000	▲ 2,900			
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		▲ 400			
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	▲ 34,300	26,500	34,300			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	▲ 5,200	53,900	▲ 11,500			
当座預金残高	5,526,900	5,580,800	5,569,300			
準備預金残高	4,807,400					
積み終了先	4,805,800			4月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,805,700			積数	10,600	
非準備預金先	719,500			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	99.72%	日数	40.00%		

## ●2023年4月27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▲0.055~▲0.045%近辺での出会いで始まった。調達ニーズが限られる中、引き続き軟調な相場展開となり、出会いの水準は前日対比でさらに低下した。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、▲0.25~▲0.15%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>

27日のアウトラ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発行市場は複数の業態で発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●2023年4月28日の予定

- \*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)
- \*日銀総裁定例会見 \*経済・物価情勢の展望
- \*3月の完全失業率(市場予想:2.5%) \*3月の有効求人倍率(市場予想:1.34倍)
- \*4月の都区部消費者物価指数(GPI)(市場予想:前年同期比(除く生鮮)+3.2%)
- \*3月の商業動態統計速報
- \*3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+0.5%)
- \*3月の住宅着工統計 \*3月の米個人所得・消費支出
- \*4月のシカゴPM景況感指数 \*1-3月期のユーロ圏GDP1次速報

## ●短期金融市場関連指標

2023/4/27	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.049					-	▲ 0.161	0.455	0.000	28,457.68	41.21	133.44-46	133.78-79
T/N			▲ 0.060					-	▲ 0.210						
S/N			▲ 0.030					-	-						
1W	▲ 0.050	▲ 0.030	▲ 0.047					-	▲ 0.191						
2W								-	▲ 0.187						
3W								-	▲ 0.179						
1M			▲ 0.001					-	▲ 0.180						
3M	0.001	0.011	0.006					▲ 0.185	▲ 0.166						
6M								▲ 0.172	▲ 0.129						
1Y								▲ 0.147	▲ 0.102						
日付		4/20	4/21	4/24	4/25	4/26									
日銀当預残		5,529,600	5,523,700	5,553,100	5,554,800	5,532,100									
準備預金残		4,816,300	4,816,400	4,842,600	4,833,400	4,815,900									
マネタリーベース		6,795,200	6,790,000	6,820,400	6,823,700	6,803,000									
無担O/N加重平均		▲0.009%	▲0.010%	▲0.013%	▲0.019%	▲0.031%									
コール市場残高		205,035	205,094	206,168	206,142	206,420									
うち無担		178,329	180,408	182,034	180,379	178,594									
うちO/N		97,533	99,862	102,713	99,779	97,791									
うち有担		26,706	24,686	24,134	25,772	27,826									

## ●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非償付競争入札(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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/4/28		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		2023/4/28		0.240	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/4/28			7,715	5,004	▲0.007		▲0.004	26.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/4/28			11,607	6,757	▲0.004		▲0.002	28.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2023/4/28			4,900	2,504	▲0.008		▲0.004	11.3
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/4/28			2,576	1,005	0.005		0.008	97.6
国債買入(物価連動債)	600	2023/4/28			1,972	600		▲0.520	▲0.520	
米ドル資金供給		2023/5/1	2023/5/11	5.110	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/27	2023/4/28	▲0.350	34,384	34,384		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/27	2023/4/28	▲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。

◆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