

Central Daily Market Report

2023年4月28日(金)

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28日 需給速報	2023年5月1日 需給予想	2023年5月2日 当社予想			
銀行券	▲ 1,400	▲ 900	500			
財政	800	▲ 22,400	▲ 13,000			
資金過不足	▲ 600	▲ 23,300	▲ 12,500			
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	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		▲ 400				
新型コロナウイルス感染症支援特別						
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 48,500	34,300	48,500			
※ドル資金供給用担保確保供給						
当増増減	2,300	25,200	▲ 12,500			

当座預金残高	5,529,200	5,554,400	5,541,900	
準備預金残高	4,798,800			
積み終了先	4,797,300			
超過準備	4,796,900			
非準備預金先	730,400			
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	99.87%	日数	50.00%

●短期金融市場関連指標

2023/4/28	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均		
単位: %							売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.073				-	▲ 0.165
T/N	▲ 0.055	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.153
S/N	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.046				-	-
1W			▲ 0.043				-	▲ 0.167
2W							-	▲ 0.168
3W							-	▲ 0.169
1M							-	▲ 0.167
3M							▲ 0.185	▲ 0.163
6M							▲ 0.172	▲ 0.129
1Y							▲ 0.147	▲ 0.102

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円		
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
0.390	▲ 0.065	28,856.44	398.76	133.79-82	135.71-74	
日付		4/21	4/24	4/25	4/26	4/27
日銀当預残	5,523,700	5,553,100	5,554,800	5,532,100	5,526,900	
準備預金残	4,816,400	4,842,600	4,833,400	4,815,900	4,807,400	
マネタリーベース	6,790,000	6,820,400	6,823,700	6,803,000	6,800,600	
無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.013%	▲ 0.019%	▲ 0.031%	▲ 0.049%	
コール市場残高	205,094	206,168	206,142	206,420	202,041	
うち無担	180,408	182,034	180,370	178,594	176,805	
うちO/N	99,862	102,713	99,779	97,791	95,102	
うち有担	24,686	24,134	25,772	27,826	25,236	

●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)	抜分レート ・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	抜分 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		2023/5/1		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		2023/5/1		0.240	0	0				
米ドル資金供給		2023/5/2	2023/5/11	5.210	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/28	2023/5/1	▲ 0.450	48,740	48,740		▲ 0.450	▲ 0.450	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/5/1		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)※4		2023/5/1		0.240	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/28	2023/5/1	▲ 0.450	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)の場合は、上期限満利回り。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。※4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。

●日銀政策決定会合・結果

- 当面の金融政策運営について
- 1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。
 - (1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(全員一致)
 - ① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。
短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
 - ② 長短金利操作の運用
長期金利の変動幅を「±0.5%程度」とし、10年物国債金利について0.5%の利回りでの指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。上記の金融市場調節方針と整合的なイールドカーブの形成を促すため、大規模な国債買入れを継続するとともに、各年限において、機動的に、買入れ額の増額や指値オペを実施する。
 - (2) 資産買入れ方針(全員一致)
 - 長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
 - ① ETFおよびJ-REITについては、それぞれ年間約1.2兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ベースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
 - ② CP等は、約2兆円の残高を維持する。社債等は、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(約3兆円)へと徐々に戻していく。ただし、社債等の買入れ残高の調整は、社債の発行環境に十分配慮して進めることとする。

◆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

●2023年4月28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▲0.080~▲0.070%近辺での出会いが始まった。週末3日積みとなったものの月末でもあった事から、ビッドサイドの資金調達ニーズは限られ、レートは大きく低下した。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

また、金融政策決定会合では現状維持となったが、フォワードガイダンスが一部変更された。加えて、1990年代後半以降の金融政策運営について、1年から1年半程度の時間をかけて、多角的にレビューを行う事となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.18~▲0.13%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>

28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発行市場は一部の業態で大型発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●入札結果

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。

●2023年5月1日の予定

- *4月の消費動向調査
- *4月のISM製造業景況指数
- *3月の米建設支出
- *EURO祝日(Labour Day) London祝日(May Day)