

Central Daily Market Report

2023年5月1日(月)

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5月1日 需給速報	2023年5月2日 需給予想	2023年5月8日 当社予想			
銀行券	▲ 900	▲ 500	4,000			
財政	▲ 22,800	▲ 15,500	▲ 35,000			
資金過不足	▲ 23,700	▲ 16,000	▲ 31,000			
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						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 44,100	48,500	44,100			
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 19,300	28,100	▲ 31,000			
当座預金残高	5,509,900	5,538,000	5,507,000			
準備預金残高	4,789,400					
積み終了先	4,788,700			5月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,788,500			積数	4,100	
非準備預金先	720,500			1日平均	300	
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	99.89%	日数	53.33%		

●2023年5月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢からの調達を中心に▲0.08~▲0.07%近辺の出合いで始まった。月末要因が剥落するも、依然としてビッドサイドの資金調達ニーズは限定的となり、出合いの水準は概ね横ばいで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.22~▲0.15%程度での出合いとなった。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>

1日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

本日のCP発行市場は閑散としたマーケットとなった。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

2023/5/1	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.073				-	▲ 0.134	0.400	0.010	29,123.18	266.74	136.38-40	136.72-73
T/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.038				-	▲ 0.174						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.075	▲ 0.030	▲ 0.055				-	▲ 0.171						
2W	▲ 0.050	0.000	▲ 0.030				-	▲ 0.169						
3W							-	▲ 0.171						
1M			0.000				-	▲ 0.170						
3M			0.022				▲ 0.185	▲ 0.164						
6M							▲ 0.172	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
									日付	4/24	4/25	4/26	4/27	4/28
									日銀当預残	5,553,100	5,554,800	5,532,100	5,526,900	5,529,200
									準備預金残	4,842,600	4,833,400	4,815,900	4,807,400	4,798,800
									マネタリーベース	6,820,400	6,823,700	6,803,000	6,800,600	6,804,400
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.019%	▲0.031%	▲0.049%	▲0.073%
									コール市場残高	206,168	206,142	206,420	202,041	200,458
									うち無担	182,034	180,370	178,594	176,805	177,458
									うちO/N	102,713	99,779	97,791	95,102	101,020
									うち有担	24,134	25,772	27,826	25,236	23,000

●入札結果

名称	回数	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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/2		0.110	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		2023/5/2		0.290	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/1	2023/5/2	▲0.450	44,120	44,120		▲0.450	▲0.451	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/1	2023/5/2	▲0.450	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5月2日の予定

*4月のマネタリーベース *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*米FOMC(1日目) *3月の米製造業新規受注・出荷・在庫 *4月のユーロ圏消費者物価指数速報値	*国庫短期証券(1154回)入札 (3ヶ月、63,000億円、5/8発行) *流動性供給入札 (5,000億円、5/8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