

Central Daily Market Report

2023年5月8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8日 需給速報	2023年5月9日 需給予想	2023年5月10日 当社予想			
銀行券	2,500	2,900	1,500			
財政	▲ 33,100	▲ 4,700	▲ 28,000			
資金過不足	▲ 30,600	▲ 1,800	▲ 26,500			
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						▲ 10,900
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		12,800				
CP等買入		▲ 200		▲ 200		
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	▲ 41,000	31,600		41,000		
※ドル資金供給用担保提供増減						
当増増減	▲ 40,200	51,800		▲ 37,400		
当座預金残高	5,468,000	5,519,800		5,482,400		
準備預金残高	4,775,200					
積み終了先	4,774,600			5月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,774,600			積数	1,600	
非準備預金先	692,800			1日平均	200	
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	99.96%		日数	76.67%	

●2023年5月8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~▲0.06%近辺の出合いで始まった。一巡後も同水準の出合いが継続し、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.095%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>

8日のアウトラ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>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/5/8	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	
	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.073				-	▲ 0.097	0.409	▲ 0.006	28,949.88	▲ 208.07	135.18-20	135.02-04
T/N							-	▲ 0.103						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.070	▲ 0.025	▲ 0.055				-	▲ 0.123						
2W	▲ 0.075	0.001	▲ 0.051				-	▲ 0.132						
3W			▲ 0.010				-	▲ 0.141						
1M	▲ 0.035	▲ 0.020	▲ 0.028				-	▲ 0.150						
3M			0.004				▲ 0.174	▲ 0.157						
6M							▲ 0.172	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付	4/26	4/27	4/28	5/1	5/2									
日銀当預残	5,532,100	5,526,900	5,529,200	5,509,900	5,508,200									
準備預金残	4,815,900	4,807,400	4,798,800	4,789,400	4,801,000									
マネタリーベース	6,803,000	6,800,600	6,804,400	6,786,100	6,784,700									
無担O/N加重平均	▲0.031%	▲0.049%	▲0.073%	▲0.073%	▲0.074%									
コール市場残高	206,420	202,041	200,458	188,764	188,661									
うち無担	178,594	176,805	177,458	165,864	166,861									
うちO/N	97,791	95,102	101,020	88,526	93,513									
うち有担	27,826	25,236	23,000	22,900	21,800									

●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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/9		0.085	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		2023/5/9		0.270	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/5/9			4,653	1,500		0.000	0.006	
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/5/9			11,195	4,257	0.000		0.001	47.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/5/9			13,505	5,006	▲0.001		0.001	83.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/5/9			3,943	2,006	0.001		0.004	18.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/8	2023/5/9	▲0.450	41,106	41,106		▲0.450	▲0.450	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/8	2023/5/9	▲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9日の予定

*3月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比+0.4%)	*国庫短期証券(1155回)入札 (6ヶ月、40,000億円、5/10発行)	*10年利付国債入札 (27,000億円、5/10発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、5/17借入)
*3月の毎月勤労統計調査速報			

◆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