

Central Daily Market Report

2023年5月9日(火)

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9日 需給速報	2023年5月10日 需給予想	2023年5月11日 当社予想			
銀行券	2,800	2,500	2,000			
財政	▲ 5,600	▲ 35,200	▲ 2,000			
資金過不足	▲ 2,800	▲ 32,700	0			
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			7,900	▲ 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		▲ 100		
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感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 35,200	41,000		35,200		
当増増減	15,600	▲ 600				0
当座預金残高	5,483,600	5,483,000		5,483,000		
準備預金残高	4,798,500					
積み終了先	4,798,100				5月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,798,000				積数	1,200
非準備預金先	685,100				1日平均	200
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額						3,872,100
準備預金進捗率	実績	99.97%		日数		80.00%

●2023年5月9日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢の調達を中心に▲0.075~▲0.065%近辺の出会いで始まった。一巡後も同水準の出会いが継続し、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームでの引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.085%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>

9日はTB6M物(第1155回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、横ばい圏で推移した。この他、3M物でも出会いが見られた。

<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

2023/5/9	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	▲ 0.083	0.001	▲ 0.070				-	▲ 0.103	0.420	0.011	29,242.82	292.94	135.08-09	134.80-82
T/N							-	▲ 0.098						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.060	▲ 0.050	▲ 0.056				-	▲ 0.126						
2W							-	▲ 0.136						
3W							-	▲ 0.142						
1M			▲ 0.003				-	▲ 0.151						
3M							▲ 0.172	▲ 0.155						
6M							▲ 0.168	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		4/27	4/28	5/1	5/2	5/8								
日銀当預残	5,526,900	5,529,200	5,509,900	5,508,200	5,468,000									
準備預金残	4,807,400	4,798,800	4,789,400	4,801,000	4,775,200									
マネタリーベース	6,800,600	6,804,400	6,786,100	6,784,700	6,741,900									
無担O/N加重平均	▲0.049%	▲0.073%	▲0.073%	▲0.074%	▲0.073%									
コール市場残高	202,041	200,458	188,764	188,661	183,908									
うち無担	176,805	177,458	165,864	166,861	156,980									
うちO/N	95,102	101,020	88,526	93,513	88,407									
うち有担	25,236	23,000	22,900	21,800	26,928									

●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非償還格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1155	-	40,000	2023/5/10	2023/11/10	127,982.0	32,538.8	100.0770	▲0.1526%	58.4068%	100.0850	▲0.1684%	7,461	
10年利付国債	370	0.500%	27,000	2023/5/10	2033/3/20	78,571.0	21,826.0	100.6100	0.4350%	90.8079%	100.7000	0.4260%	5,158	12.86
交付税特会	-	-	13,000	2023/5/17	2023/11/16	480,181.0	13,000.29		0.0000%	2.7074%		0.0000%		-

●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		2023/5/10		0.091	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		2023/5/10		0.290	0	0				
米ドル資金供給		2023/5/11	2023/5/18	5.320	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/9	2023/5/10	▲0.350	35,174	35,174		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/5/10	2023/5/24	0.000	7,945	7,945				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/9	2023/5/10	▲0.350	21	21		▲0.350	▲0.350	

*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10日の予定

*4月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*4月の米消費者物価指数
*3月の景気動向指数速報	*4月の米財政収支

◆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