

Central Daily Market Report

2023年5月11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5月11日 需給速報	2023年5月12日 需給予想	2023年5月15日 当社予想			
銀行券	1,100	1,600	1,500			
財政	▲ 3,000	▲ 17,900	▲ 6,000			
資金過不足	▲ 1,900	▲ 16,300	▲ 4,500			
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		1,000				
国債買入						
CP等買入	▲ 100		▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援		200	▲ 900			
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	▲ 28,700	30,000	28,700			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	▲ 700	12,600	▲ 4,500			
当座預金残高	5,452,700	5,465,300	5,460,800			
準備預金残高	4,763,900					
積み終了先	4,763,500			5月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,763,500			積数	300	
非準備預金先	688,800			1日平均	100	
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	99.99%	日数	86.67%		

●2023年5月11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▲0.055~▲0.045%近辺の出会いが始まった。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引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.100~▲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>

11日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、強め結果となった。マーケットで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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。また、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、全取レート▲0.028%、平均レート+0.014%となり、最低落札レートは昨年7月8日以来のマイナスとなった。

●短期金融市場関連指標

2023/5/11	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.046					-	▲ 0.097	0.385	▲ 0.025	29,126.72	4.54	134.08-11	134.54-56
T/N								-	▲ 0.100						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.048	▲ 0.035	▲ 0.038					-	▲ 0.124						
2W	▲ 0.035	0.040	▲ 0.017					-	▲ 0.136						
3W								-	▲ 0.142						
1M			0.100					-	▲ 0.150						
3M								▲ 0.172	▲ 0.154						
6M								▲ 0.165	▲ 0.129						
1Y								▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		5/1	5/2	5/8	5/9	5/10									
日銀当預残	5,509,900	5,508,200	5,468,000	5,483,600	5,453,400										
準備預金残	4,789,400	4,801,000	4,775,200	4,798,500	4,778,700										
マネタリーベース	6,786,100	6,784,700	6,741,900	6,754,700	6,722,000										
無担O/N加重平均	▲0.073%	▲0.074%	▲0.073%	▲0.070%	▲0.061%										
コール市場残高	188,764	188,661	183,908	179,426	189,497										
うち無担	165,864	166,861	156,980	154,773	162,548										
うちO/N	88,526	93,513	88,407	85,300	93,565										
うち有担	22,900	21,800	26,928	24,653	26,949										

●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非価格競争入札(億円)
30年利付国債	78	1.400%	9,000	2023/5/12	2053/3/20	25,517.0	7,314.0	103.1000	1.2570%	79.9768%	103.2000	1.2520%	1,674.0
エネルギー対策	-	-	8,400	2023/5/22	2024/5/20	206,684.0	8,399.98		0.0000%	4.0642%		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
国庫短期証券買入	1,000	2023/5/12			4,401	1,001	0.000		0.001	47.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/5/12		0.090	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		2023/5/12		0.275	0	0				
CP等買入	4,000	2023/5/16			4,525	3,995		▲0.028	0.014	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/11	2023/5/12	▲0.350	28,606	28,606		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/11	2023/5/12	▲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。

●2023年5月12日の予定

*4月のマネーストック	*5月のミシガン大消費者信頼感指数速報 *1-3月期の英GDP速報値	*国庫短期証券(1156回)入札 (3ヶ月、63,000億円、5/15発行)
-------------	---------------------------------------	---

◆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