

# Central Daily Market Report

2023年5月12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5月12日 需給速報	2023年5月15日 需給予想	2023年5月16日 当社予想			
銀行券	1,700	1,500	2,000			
財政	▲19,600	▲2,500	▲26,000			
資金過不足	▲17,900	▲1,000	▲24,000			
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	1,000					
国債買入		13,700				
CP等買入		▲100	▲400	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入	200	▲900				
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	▲24,400	28,700	24,400			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当増増減	▲13,400	36,700	▲20,000			
当座預金残高	5,439,300	5,476,000	5,456,000			
準備預金残高	4,770,900					
積み終了先	4,770,800			5月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,770,800			積数	0	
非準備預金先	668,400			1日平均	0	
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	100.00%	日数	96.67%		

## ●2023年5月12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▲0.04~▲0.025%近辺の出会いが始まった。週初からレート水準が徐々に上昇する展開となる中、本日は今積み期最後の週末となった事で一段と上昇した水準での取引が中心となった。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、▲0.095~▲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>

12日はTB3M物(第1156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。その他、6M物・1Y物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

2023/5/12	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	▲0.060	0.001	▲0.030					-	▲0.091	0.380	▲0.005	29,388.30	261.58	134.47-48	134.85-87
T/N								-	▲0.095						
S/N								-	-						
1W			▲0.035					-	▲0.123						
2W	▲0.034	▲0.018	▲0.026					-	▲0.135						
3W								-	▲0.142						
1M			▲0.013					-	▲0.149						
3M								▲0.175	▲0.157						
6M								▲0.175	▲0.129						
1Y								▲0.162	▲0.102						
日付										5/2	5/8	5/9	5/10	5/11	
日銀当預残										5,508,200	5,468,000	5,483,600	5,453,400	5,452,700	
準備預金残										4,801,000	4,775,200	4,798,500	4,778,700	4,763,900	
マネタリーベース										6,784,700	6,741,900	6,754,700	6,722,000	6,720,100	
無担O/N加重平均										▲0.074%	▲0.073%	▲0.070%	▲0.061%	▲0.046%	
コール市場残高										188,661	183,908	179,426	189,497	186,666	
うち無担										166,861	156,980	154,773	162,548	160,069	
うちO/N										93,513	88,407	85,300	93,565	89,736	
うち有担										21,800	26,928	24,653	26,949	26,597	

## ●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)
国庫短期証券	1156	-	63,000	2023/5/15	2023/8/14	154,139.0	51,062.40	100.0415	▲0.1663%	82.5207%	100.0438	▲0.1756%	11,937.0

## ●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*	応募総額(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		2023/5/15		0.115	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		2023/5/15		0.305	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/5/15			7,183	4,251	▲0.008		▲0.004	58.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,250	2023/5/15			13,550	6,265	▲0.014		▲0.012	62.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/5/15			4,138	2,005	▲0.009		▲0.007	85.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/5/15			3,444	1,002	▲0.003		▲0.002	64.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/12	2023/5/15	▲0.350	24,396	24,396		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/12	2023/5/15	▲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15日の予定

*4月の企業物価指数	*5年利付国債入札
*3月の特定サービス産業動態統計速報	(25,000億円、5/16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