

Central Daily Market Report

2023年4月5日(水)

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4月5日 需給速報	2023年4月6日 需給予想	2023年4月7日 当社予想			
銀行券	400	▲ 200	500			
財政	▲ 24,700	▲ 2,000	▲ 9,000			
資金過不足	▲ 24,300	▲ 2,200	▲ 8,500			
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	8,300	▲ 8,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入			13,200			
CP等買入		▲ 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	▲ 34,400	42,000	35,000			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 17,000	47,000	▲ 8,500			
当座預金残高	5,445,300	5,492,300	5,483,800			
準備預金残高	4,751,600					
積み終了先	4,751,500			4月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,751,500			積数	500	
非準備預金先	693,700			1日平均	0	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,909,200	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	67.74%		

●2023年4月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.01~▲0.002%近辺での出合いとなった。引き続きビッドサイドの調達意欲は旺盛な中、レート水準は前日に比べ若干上昇した。出合い一巡後は、ビッド水準がやや低下し、▲0.01%前後で散発的な出合いが見られた程度で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散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.11~▲0.10%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>

5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、軟調な結果となった。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

2023/4/5	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.007					-	▲ 0.098	0.465	▲ 0.005	27,813.26	▲ 474.16	131.43-44	131.39-42
T/N								-	▲ 0.111						
S/N			0.001					-	-						
1W	▲ 0.007	0.000	▲ 0.004					-	▲ 0.137						
2W								-	▲ 0.142						
3W								-	▲ 0.150						
1M								-	▲ 0.166						
3M								▲ 0.195	▲ 0.169						
6M								▲ 0.160	▲ 0.127						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.098						
日付		3/29	3/30	3/31	4/3	4/4									
日銀当預残		5,465,700	5,493,700	5,490,800	5,461,500	5,462,300									
準備預金残		4,783,900	4,805,800	4,859,200	4,758,600	4,760,900									
マネタリーベース		6,733,800	6,762,100	6,758,500	6,728,500	6,728,500									
無担O/N加重平均		▲0.015%	▲0.014%	▲0.030%	▲0.009%	▲0.008%									
コール市場残高		191,622	196,752	138,582	185,053	187,105									
うち無担		164,754	169,903	117,777	156,211	156,181									
うちO/N		93,013	97,567	69,771	91,410	86,620									
うち有担		26,868	26,849	20,805	28,842	30,924									

●入札結果

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
国庫短期証券買入	1,000	2023/4/6			4,954	1,000	0.023		0.023	40.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/4/6		0.030	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		2023/4/6		0.200	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/4/6			5,198	1,501	▲0.005		▲0.002	85.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/4/6			8,882	4,257	▲0.005		▲0.003	34.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/4/6			10,733	5,004	0.002		0.003	95.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2023/4/6			5,290	2,509	0.002		0.006	37.2
米ドル資金供給		2023/4/7	2023/4/14	5.070	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/4/5	2023/4/6	▲1.100	463	463		▲1.100	▲2.566	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/5	2023/4/6	▲0.350	33,950	33,950		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/5	2023/4/6	▲0.350	8	8		▲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。

※3国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)の売却銘柄は、利付国(10年)第368回です。

●2023年4月6日の予定

*国庫短期証券(1149回)入札 (6ヶ月、40,000億円、4/10発行)	*30年利付国債入札 (9,000億円、4/7発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、4/14借入)
◆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		