

Central Daily Market Report

2023年4月6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4月6日 需給速報	2023年4月7日 需給予想	2023年4月10日 当社予想			
銀行券	▲ 100	1,200	1,500			
財政	2,800	▲ 6,800	▲ 5,000			
資金過不足	2,700	▲ 5,600	▲ 3,500			
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	13,200					
CP等買入			▲ 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感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 36,500	34,400	37,100			
※ドル資金供給用担保提供額						
当増減	14,800	31,300	▲ 3,500			
当座預金残高	5,460,100	5,491,400	5,487,900			
準備預金残高	4,768,900					
積み終了先	4,768,800			4月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,768,800			積数	400	
非準備預金先	691,200			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	70.97%		

●2023年4月6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で、▲0.005%前後に多くのビッドが集まることとなり、前日に比べレート水準は若干上昇した。出合い一巡後も、調達ニーズは引き続き根強く、▲0.005%前後で散発的な出合いが見られて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、▲0.13~▲0.115%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>

6日はTB6M物(第1149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も、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/4/6	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.110	0.465	0.000	27,472.63	▲ 340.63	130.92-94	131.35-38
T/N								-	▲ 0.131						
S/N				0.001				-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.018	▲ 0.039					-	▲ 0.148						
2W	▲ 0.018	▲ 0.002	▲ 0.013					-	▲ 0.157						
3W								-	▲ 0.159						
1M				0.050				-	▲ 0.175						
3M								▲ 0.195	▲ 0.174						
6M								▲ 0.175	▲ 0.129						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.099						
日付		3/30	3/31	4/3	4/4	4/5									
日銀当預残	5,493,700	5,490,800	5,461,500	5,462,300	5,445,300										
準備預金残	4,805,800	4,859,200	4,758,600	4,760,900	4,751,900										
マネタリーベース	6,762,100	6,758,500	6,728,500	6,728,500	6,711,100										
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.030%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.007%										
コール市場残高	196,752	138,582	185,053	187,105	191,006										
うち無担	169,903	117,777	156,211	156,181	160,546										
うちO/N	97,567	69,771	91,410	86,620	90,360										
うち有担	26,849	20,805	28,842	30,924	30,460										

●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	1149	-	40,000	2023/4/10	2023/10/10	150,842.0	32,540.5	100.0730	▲0.1454%	1.1546%	100.0790	▲0.1574%	7,459.0
30年利付国債	78	1.40%	9,000	2023/4/7	2053/3/20	23,198.0	7,282.0	100.9000	1.3570%	64.4970%	101.0000	1.3530%	1,709.0
交付税特会	-	-	13,000	2023/4/14	2023/10/16	458,836.0	13,000.51		0.0000%	2.8334%		0.0000%	

●オペ結果

種類	オフー額(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		2023/4/7		0.035	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		2023/4/7		0.205	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/10	2023/4/17	5.070	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)※3		2023/4/6	2023/4/7	▲1.100	718	718		▲1.100	▲2.048	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)		2023/4/6	2023/4/7	▲0.350	35,805	35,805		▲0.350	▲0.352	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)		2023/4/6	2023/4/7	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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ー。
※3国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)の売却銘柄は、利付国債(10年)第368回です。

●2023年4月7日の予定

*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*3月の米雇用統計	*国庫短期証券(1150回)入札
*2月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+4.3%)	*EURO、London祝日(Good Friday)	(3ヶ月、63,000億円、4/10発行)
*2月の毎月勤労統計調査速報 *2月の景気動向指数速報		

◆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