

# Central Daily Market Report

2023年4月10日(月)  
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10日 需給速報	2023年4月11日 需給予想	2023年4月12日 当社予想			
銀行券	700	600	500			
財政	▲ 7,700	▲ 4,700	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 7,000	▲ 4,100	▲ 26,500			
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						
国債買入		14,600				
CP等買入	▲ 100		▲ 300			
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	700					
国債補充供給	▲ 54,400	36,000		54,400		
米ドル資金供給用担保提供増額						
当増増減	▲ 24,800		64,600		▲ 26,500	
当座預金残高	5,429,900		5,494,500		5,468,000	
準備預金残高	4,734,000					
積み終了先	4,733,900			4月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,733,900			積数	100	
非準備預金先	695,900			1日平均	0	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,918,900	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	83.87%		

## ●2023年4月10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▲0.005~▲0.002%近辺での出合いとなった。週末3日積み要因は剥落したものの各業態の調達意欲は引き続き強く、前週末と概ね同水準での取引となるなか、一巡後は、▲0.008~▲0.005%近辺で散発的に出合いが見られて本日の取引を終了した。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、▲0.15~▲0.09%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>

10日のアウトライイト市場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

2023/4/10	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	▲ 0.006					-	▲ 0.116	0.460	0.005	27,633.66	115.35	132.08-09	132.06-08
T/N								-	▲ 0.149						
S/N			0.001					-	-						
1W	▲ 0.008	▲ 0.003	▲ 0.007					-	▲ 0.164						
2W	▲ 0.020	0.040	▲ 0.004					-	▲ 0.169						
3W								-	▲ 0.174						
1M	▲ 0.005	0.070	0.014					-	▲ 0.177						
3M	0.001	0.030	0.014					▲ 0.300	▲ 0.178						
6M								▲ 0.185	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.099						
日付		4/3	4/4	4/5	4/6	4/7									
日銀当預残	5,461,500	5,462,300	5,445,300	5,460,100	5,454,700										
準備預金残	4,758,600	4,760,900	4,751,900	4,769,500	4,755,000										
マネタリーベース	6,728,500	6,728,500	6,711,100	6,726,000	6,719,400										
無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.008%	▲0.007%	▲0.006%	▲0.005%										
コール市場残高	185,053	187,105	191,006	198,146	193,769										
うち無担	156,211	156,181	160,546	168,640	166,245										
うちO/N	91,410	86,620	90,360	95,604	91,559										
うち有担	28,842	30,924	30,460	29,506	27,524										

## ●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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/4/11		0.045	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		2023/4/11		0.215	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/4/11			14,682	4,252	0.011		0.013	92.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/4/11			15,386	6,764	0.006		0.008	90.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,500	2023/4/11			4,149	2,504	▲0.004		0.005	48.1
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/4/11			2,632	1,002	0.016		0.018	47.3
米ドル資金供給		2023/4/12	2023/4/19	5.070	0	0				
CP等買入	4,000	2023/4/13			6,435	3,995	0.002		0.011	8.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/4/10	2023/4/11	▲1.100	874	874		▲1.100	▲1.382	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/10	2023/4/11	▲0.350	53,529	53,529		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/10	2023/4/11	▲0.350	140	140		▲0.350	▲0.350	

## ●2023年4月11日の予定

\*5年利付国債入札  
(25,000億円、4/12発行)

\*エネルギー対策借入  
(8,500億円、4/20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