

# Central Daily Market Report

2023年4月11日(火)

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11日 需給速報	2023年4月12日 需給予想	2023年4月13日 当社予想			
銀行券	600	200	▲ 2,000			
財政	▲ 7,300	▲ 27,200	1,000			
資金過不足	▲ 6,700	▲ 27,000	▲ 1,000			
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	14,600					
CP等買入		▲ 300	▲ 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						
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						
国債補完供給	▲ 48,400	54,400	48,400			
米ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	13,600	22,000	3,000			
当座預金残高	5,443,500	5,465,500	5,468,500			
準備預金残高	4,749,200					
積み終了先	4,749,200			4月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,749,200			積数	100	
非準備預金先	694,300			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	87.10%		

## ●2023年4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、邦銀業態を中心に▲0.005~▲0.002%近辺での出合いとなった。引き続き各業態の調達意欲が強く、レート水準は前日から概ね横這い圏で推移する展開となった。一巡後は、ビッド数が減少した事でレートがやや低下し、▲0.055~▲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、▲0.12~▲0.08%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>

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た。結果は、前回比(4/5、按分・平均ともに0.023%)で按分・平均ともに0.001%上昇し、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

2023/4/11	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.007					-	▲ 0.102	0.450	▲ 0.010	27,923.37	289.71	133.46-48	133.13-16
T/N								-	▲ 0.120						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.032					-	▲ 0.160						
2W	▲ 0.018	▲ 0.008	▲ 0.014					-	▲ 0.165						
3W								-	▲ 0.172						
1M								-	▲ 0.177						
3M								▲ 0.300	▲ 0.175						
6M								▲ 0.185	▲ 0.131						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.099						
日付		4/4	4/5	4/6	4/7	4/10									
日銀当預残	5,462,300	5,445,300	5,460,100	5,454,700	5,429,900										
準備預金残	4,760,900	4,751,900	4,769,500	4,755,000	4,734,000										
マネタリーベース	6,728,500	6,711,100	6,726,000	6,719,400	6,693,800										
無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.007%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.006%										
コール市場残高	187,105	191,006	198,146	193,769	194,127										
うち無担	156,181	160,546	168,640	166,245	167,756										
うちO/N	86,620	90,360	95,604	91,559	92,220										
うち有担	30,924	30,460	29,506	27,524	26,371										

## ●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
5年利付国債	157	0.200%	25,000	2023/4/12	2028/3/20	80,206.0	20,319.0	100.2000	0.1590%	11.0649%	100.2100	0.1570%	4,662	10.00
エネルギー対策	-	-	8,500	2023/4/20	2024/4/22	233,528.0	8,499.87		0.0000%	3.6398%		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	2023/4/12			6,050	1,000		0.024	0.024	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/4/12		0.040	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		2023/4/12		0.206	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/13	2023/4/20	5.080	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/4/11	2023/4/12	▲1.100	785	785		▲1.100	▲1.375	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/11	2023/4/12	▲0.350	47,614	47,614		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/11	2023/4/12	▲0.350	200	200		▲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、利付国債(10年)第368回です。

## ●2023年4月12日の予定

*2月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲7.8%)	*3月の米消費者物価指数	*3月の米財政収支
◆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		