

Central Daily Market Report

2023年4月12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12日 需給速報	2023年4月13日 需給予想	2023年4月14日 当社予想			
銀行券	100	▲ 500	▲ 1,500			
財政	▲ 30,400	▲ 1,900	79,000			
資金過不足	▲ 30,300	▲ 2,400	77,500			
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						
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 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				▲ 100		
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	▲ 46,100	48,400	46,100			
米ドル資金供給用担保債提供						
当増減	▲ 27,400	47,500	77,500			
当座預金残高	5,416,100	5,463,600	5,541,100			
準備預金残高	4,727,500					
積み終了先	4,727,500			4月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,727,500			積数	100	
非準備預金先	688,600			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	90.32%		

●2023年4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、邦銀業態を中心に▲0.005~▲0.003%近辺での出合いとなった。引き続き調達意欲の強い状況が続く中、一巡後は、レート水準がやや低下し、▲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、▲0.10~▲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>

12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

2023/4/12	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					-	▲ 0.088	0.460	0.010	28,082.70	159.33	133.59-61	133.83-86
T/N								-	▲ 0.098						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.005					-	▲ 0.137						
2W	▲ 0.018	▲ 0.015	▲ 0.017					-	▲ 0.149						
3W								-	▲ 0.161						
1M								-	▲ 0.164						
3M	0.003	0.004	0.004					▲ 0.300	▲ 0.172						
6M								▲ 0.185	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.099						
日付		4/5	4/6	4/7	4/10	4/11									
日銀当預残	5,445,300	5,460,100	5,454,700	5,429,900	5,443,500										
準備預金残	4,751,900	4,769,500	4,755,000	4,734,000	4,749,100										
マネタリーベース	6,711,100	6,726,000	6,719,400	6,693,800	6,706,900										
無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.007%										
コール市場残高	191,006	198,146	193,769	194,127	193,670										
うち無担	160,546	168,640	166,245	167,756	168,352										
うちO/N	90,360	95,604	91,559	92,220	92,146										
うち有担	30,460	29,506	27,524	26,371	25,318										

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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		2023/4/13		0.050	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		2023/4/13		0.225	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/14	2023/4/21	5.070	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/4/12	2023/4/13	▲1.100	902	902		▲1.100	▲1.340	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/12	2023/4/13	▲0.350	45,288	45,288		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/12	2023/4/13	▲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国債補充供給(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13日の予定

*3月のマネーストック	*3月の米生産者物価指数	*流動性供給入札(5,000億円、4/14発行)
-------------	--------------	--------------------------

◆本資料は信頼できるとさ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