

Central Daily Market Report

2023年4月13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13日 需給速報	2023年4月14日 需給予想	2023年4月17日 当社予想	
銀行券	▲ 500	0	1,000	
財政	▲ 6,500	77,500	10,500	
資金過不足	▲ 7,000	77,500	11,500	
金融調節	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				
CP等買入	4,000	▲ 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		▲ 100		
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	▲ 45,000	46,100	45,000	
※ドル資金供給用担保債提供				
当増増減	▲ 2,100	122,200	11,500	
当座預金残高	5,414,000	5,536,200	5,547,700	
準備預金残高	4,727,300			
積み終了先	4,727,200		4月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,727,200		積数	0
非準備預金先	686,700		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	93.55%

●2023年4月13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。今積み期の営業日数は、本日を含め残り2日間となったが、ビッドサイドの調達意欲の強さは変わらず、前日から概ね横這い水準での取引となった。一巡後は、ビッド数がやや減少する中、▲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、▲0.105~▲0.095%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>

13日のアウトラ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

2023/4/13	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	
	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				-	▲ 0.091	0.455	▲ 0.005	28,156.97	74.27	133.08-09	133.02-03
T/N							-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.132						
2W	▲ 0.018	▲ 0.007	▲ 0.013				-	▲ 0.141						
3W			▲ 0.015				-	▲ 0.154						
1M			▲ 0.010				-	▲ 0.159						
3M	0.004	0.028	0.018				▲ 0.300	▲ 0.168						
6M							▲ 0.185	▲ 0.130						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.099						
日付	4/6	4/7	4/10	4/11	4/12									
日銀当預残	5,460,100	5,454,700	5,429,900	5,443,500	5,416,100									
準備預金残	4,769,500	4,755,000	4,734,000	4,749,100	4,727,500									
マネタリーベース	6,726,000	6,719,400	6,693,800	6,706,900	6,679,300									
無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.007%	▲0.006%									
コール市場残高	198,146	193,769	194,127	193,670	202,645									
うち無担	168,640	166,245	167,756	168,352	174,445									
うちO/N	95,604	91,559	92,220	92,146	96,479									
うち有担	29,506	27,524	26,371	25,318	28,200									

●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)
流動性供給	379	-	5,000	2023/4/14	-	13,969.0	4,995.0		▲0.011%	96.0084%		▲0.013%	

●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*	応募総額(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		2023/4/14		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		2023/4/14		0.215	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/17	2023/4/24	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		2023/4/13	2023/4/14	▲1.100	870	870		▲1.100	▲1.325	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/4/13	2023/4/14	▲0.350	44,285	44,285		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/4/13	2023/4/14	▲0.350	0	0				

*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14日の予定

*3月の米小売売上高	*国庫短期証券(1151回)入札 (3ヶ月、63,000億円、4/17発行)
*3月の米鉱工業生産・設備稼働率	*交付税特別会計借入 (13,000億円、4/24借入)
*4月のミシガン大消費者信頼感指数速報	
*2月の米企業在庫	

◆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