

Central Daily Market Report

2023年5月2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5月2日 需給速報	2023年5月8日 需給予想	2023年5月9日 当社予想			
銀行券	▲ 400	2,700	3,000			
財政	▲ 13,800	▲ 29,200	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 14,200	▲ 26,500	2,000			
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						
国債買入						
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	▲ 31,600	44,100	31,600			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 1,700	4,900	2,000			
当座預金残高	5,508,200	5,513,100	5,515,100			
準備預金残高	4,801,000					
積み終了先	4,800,800			5月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,800,700			積数	2,100	
非準備預金先	707,200			1日平均	300	
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額					3,846,600	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	73.33%		

●2023年5月2日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢からの調達を中心に▲0.08~▲0.07%近辺の出会いで始まった。連休前の取引となり、オファーサイドからは早めに運用に目処をつけたいというニーズが見られ、立ち上がりからギブン地合いとなったが、ビッドサイドの資金調達ニーズも一定程度見られた事で、レート水準は概ね横這い圏で推移した。ターム物は目立った出会いなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.19~▲0.085%程度での出会いとなった。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>

2日はTB3M物(第1154回)の入札が実施され、小じっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2023/5/2	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.087	0.001	▲ 0.074				-	▲ 0.224	0.415	0.015	29,157.95	34.77	137.51-54	137.59-61
T/N							-	▲ 0.153						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.162						
2W	▲ 0.050	▲ 0.045	▲ 0.049				-	▲ 0.164						
3W							-	▲ 0.168						
1M	0.000	0.100	0.018				-	▲ 0.170						
3M			0.004				▲ 0.174	▲ 0.164						
6M							▲ 0.172	▲ 0.131						
1Y							▲ 0.150	▲ 0.102						
日付		4/25	4/26	4/27	4/28	5/1								
日銀当預残	5,554,800	5,532,100	5,526,900	5,529,200	5,509,900									
準備預金残	4,833,400	4,815,900	4,807,400	4,798,800	4,789,400									
マネタリーベース	6,823,700	6,803,000	6,800,600	6,804,400	6,786,100									
無担O/N加重平均	▲0.019%	▲0.031%	▲0.049%	▲0.073%	▲0.073%									
コール市場残高	206,142	206,420	202,041	200,458	188,764									
うち無担	180,370	178,594	176,805	177,458	165,864									
うちO/N	99,779	97,791	95,102	101,020	88,526									
うち有担	25,772	27,826	25,236	23,000	22,900									

●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	1154	-	63,000	2023/5/8	2023/8/7	139,391.9	51,062.7	100.0390	▲0.1563%	58.7661%	100.0415	▲0.1663%	11,937.0
流動性供給	381	-	5,000	2023/5/8	-	22,089.0	4,977.00		0.0050%	53.9755%		0.0040%	

●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		2023/5/8		0.100	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		2023/5/8		0.280	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/5/2	2023/5/8	▲0.450	31,609	31,609		▲0.450	▲0.451	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/5/2	2023/5/8	▲0.450	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。

●2023年5月3日の予定

●2023年5月4日の予定

●2023年5月5日の予定

●2023年5月8日の予定

*憲法記念日	*みどりの日	*こどもの日	*5月の日銀当座預金増減要因見込み
*米FOMC(2日目)	*ECB定例理事会	*4月の米雇用統計	*金融政策決定会合議事要旨(3月9・10日分)
*4月のISM非製造業景況指数	*3月の米貿易収支	*3月の米消費者信用残高	*3月の米卸売売上高

◆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