

Central Daily Market Report

2023年3月1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3月1日 需給速報	2023年3月2日 需給予想	2023年3月3日 当社予想			
銀行券	▲ 200	▲ 700	▲ 500			
財政	▲ 32,300	▲ 45,500	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 32,500	▲ 46,200	▲ 27,500			
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	10,000					
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			▲ 100			
貸出支援基金(成)						▲ 2,900
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	▲ 53,500	61,800	58,800			
※10年利付国債補完供給						
当預増減	▲ 13,300	12,500	▲ 30,400			
当座預金残高	5,235,500	5,248,000	5,217,600			
準備預金残高	4,586,900					
積み終了先	4,586,300			3月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,586,100			積数	2,100	
非準備預金先	648,600			1日平均	100	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						3,518,100
準備預金進捗率	実績	99.94%	日数	50.00%		

●2023年3月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.01~▲0.008%近辺での出合いが始まった。引き続き資金調達ニーズが強い状況の中、出合いの水準は前日比、概ね横這い圏での推移となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲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>

1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発行市場は複数の業態で発行が観測され、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

2023/3/1	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.011					-	▲ 0.086	0.500	0.000	27,516.53	70.97	136.34~37	135.92~94
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.086						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.010	▲ 0.022					-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.019					-	▲ 0.103						
3W								-	▲ 0.116						
1M								-	▲ 0.145						
3M			0.230					▲ 0.180	▲ 0.145						
6M								▲ 0.145	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.090	▲ 0.083						
日付		2/21	2/22	2/24	2/27	2/28									
日銀当預残	5,247,000	5,234,600	5,241,900	5,239,800	5,248,800										
準備預金残	4,594,800	4,573,700	4,587,600	4,599,900	4,587,700										
マネタリーベース	6,514,500	6,503,100	6,510,800	6,509,100	6,518,400										
無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.008%	▲0.009%	▲0.010%	▲0.011%										
コール市場残高	196,707	193,158	191,129	189,486	202,956										
うち無担	164,880	164,112	162,299	160,383	175,490										
うちO/N	84,177	84,579	83,531	85,795	100,752										
うち有担	31,827	29,046	28,830	29,103	27,466										

●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非償格募入札(億円)	非償格入札(億円)
交付税特会	-	-	11,450	2023/3/10	2023/9/8	417,400.0	11,440.00		0.0000%	2.7408%		0.0000%		10.00

●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		2023/3/2		0.000	20	20				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/3/2		0.080	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/3/2		0.055	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/1	2023/3/2	▲1.100	20,841	20,841		▲1.100	▲4.550	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/1	2023/3/2	▲0.350	32,968	32,968		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/1	2023/3/2	▲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369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358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。

※4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367回(12,272億円)、368回(8,569億円)です。

●2023年3月2日の予定

*神奈川県金融経済懇話会において 高田日銀審議委員講演 *2月のマネタリーベース	*10-12月期の法人企業統計調査季報 *2月の消費動向調査 *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*2月のユーロ圏 消費者物価指数速報値	*10年利付国債入札 (27,000億円、3/3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