

Central Daily Market Report

2023年3月2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3月2日 需給速報	2023年3月3日 需給予想	2023年3月6日 当社予想			
銀行券	▲ 700	100	1,000			
財政	▲ 44,700	▲ 30,200	▲ 4,000			
資金過不足	▲ 45,400	▲ 30,100	▲ 3,000			
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		17,700				
CP等買入	▲ 100		▲ 200			
貸出支援基金(成)			▲ 2,500			
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入			▲ 800			
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	▲ 56,500	51,700	61,900			
※10年利付国債補完供給						
当預増減	▲ 50,300	46,000	▲ 3,000			
当座預金残高	5,185,200	5,231,200	5,228,200			
準備預金残高	4,534,100					
積み終了先	4,533,800			3月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,533,500			積数	1,500	
非準備預金先	651,100			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	99.96%	日数	53.57%		

●2023年3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、引き続き資金調達ニーズが強い状況にあるものの、一部の先からレート目線を引き下げる動きも見られた。立ち上がりは国内勢を中心に▲0.01~▲0.009%近辺の出会いとなった。一巡後はビッドが減少し、▲0.03%近辺での出会いも見られ、本日の取引を終えた。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日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は一部の業態で大型発行が実施された。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

2023/3/2	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	▲ 0.057	0.001	▲ 0.011					-	▲ 0.085	0.500	0.000	27,498.87	▲ 17.66	136.18-20	136.78-79
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.086						
S/N			▲ 0.008					-	-						
1W								-	▲ 0.097						
2W	▲ 0.025	▲ 0.009	▲ 0.020					-	▲ 0.104						
3W			▲ 0.001					-	▲ 0.115						
1M			▲ 0.018					-	▲ 0.147						
3M								▲ 0.180	▲ 0.146						
6M								▲ 0.145	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.090	▲ 0.083						
日付		2/22	2/24	2/27	2/28	3/1									
日銀当預残		5,234,600	5,241,900	5,239,800	5,248,800	5,235,500									
準備預金残		4,573,700	4,587,600	4,599,900	4,587,700	4,586,900									
マネタリーベース		6,503,100	6,510,800	6,509,100	6,518,400	6,505,300									
無担O/N加重平均		▲0.008%	▲0.009%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%									
コール市場残高		193,158	191,129	189,486	202,956	200,667									
うち無担		164,112	162,299	160,383	175,490	170,381									
うちO/N		84,579	83,531	85,795	100,752	91,793									
うち有担		29,046	28,830	29,103	27,466	30,286									

●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)
10年利付国債	369	0.50%	27,000	2023/3/3	2032/12/20	169,594.0	22,462.00	100.0000	0.5000%	30.8365%	100.0000	0.5000%	4,524.0	4.55

●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		2023/3/3		0.000	17,698	17,698				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/3/3		0.085	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		2023/3/3		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		2023/3/2	2023/3/3	▲1.100	19,439	18,854		▲1.100	▲3.423	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/2	2023/3/3	▲0.350	37,410	37,410		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/2	2023/3/3	▲0.350	150	150		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)※5		2023/3/2	2023/3/3	▲3.000	485	485		▲3.000	▲3.000	

*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(落札額11,500億円、応札額12,085億円)、368回(落札額7,354億円、応札額7,354億円)です。
※5国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)の売却銘柄は、利付国(10年)第367回です。

●2023年3月3日の予定

*3月の日銀当座預金増減要因見込み	*2月の都区部消費者物価指数(CPI)	*2月のISM 非製造業景況指数	*国庫短期証券(1142回)入札
*1月の完全失業率(市場予想:2.5%)	(市場予想:前年同月比(除く生鮮)		(3ヶ月、63,000億円、3/6発行)
*1月の有効求人倍率(市場予想:1.36倍)	+3.3%)		

◆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