

Central Daily Market Report

2023年3月3日(金)

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3日 需給速報	2023年3月6日 需給予想	2023年3月7日 当社予想			
銀行券	200	300	0			
財政	▲ 30,700	▲ 3,000	3,000			
資金過不足	▲ 30,500	▲ 2,700	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		17,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
国債補充供給	▲ 52,100	51,200		61,800		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 17,200		76,600		3,000	
当座預金残高	5,168,000		5,244,600		5,247,600	
準備預金残高	4,515,700					
積み終了先	4,515,500			3月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,515,400			積数	800	
非準備預金先	652,300			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	99.98%	日数	64.29%		

●2023年3月3日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.01~▲0.008%近辺の出合いが始まった。週末3日積みとなった事を受け、取り上がる先も見られ、レートは前日比で僅かに上昇した。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.03%近辺で散発的な出合いが見られ、今週の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが見られた。

<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>

3日はTB3M物(第1142回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、強含んで推移した。この他、1Y物でも出合いが見られた。

<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。

●2023年3月6日の予定

*1月の米製造業新規受注・出荷・在庫

●短期金融市場関連指標

2023/3/3	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	▲ 0.056	0.001	▲ 0.010					-	▲ 0.086	0.500	0.000	27,927.47	428.60	136.71-73	136.41-43
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.008					-	-						
1W								-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009					-	▲ 0.105						
3W								-	▲ 0.117						
1M								-	▲ 0.147						
3M								▲ 0.185	▲ 0.146						
6M								▲ 0.145	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.096	▲ 0.083						
日付	2/24	2/27	2/28	3/1	3/2										
日銀当預残	5,241,900	5,239,800	5,248,800	5,235,500	5,185,200										
準備預金残	4,587,600	4,599,900	4,587,700	4,586,900	4,534,700										
マネタリーベース	6,510,800	6,509,100	6,518,400	6,505,300	6,455,700										
無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.011%										
コール市場残高	191,129	189,486	202,956	200,667	201,049										
うち無担	162,299	160,383	175,490	170,381	171,829										
うちO/N	83,531	85,795	100,752	91,793	87,081										
うち有担	28,830	29,103	27,466	30,286	29,220										

●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	1142	-	63,000	2023/3/6	2023/6/12	186,894.0	50,688.9	100.0495	▲0.1842%	79.7218%	100.0496	▲0.1846%	12,311.0

●オペ結果

種類	オフター額(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		2023/3/6		0.000	2,776	2,776				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/3/6		0.077	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		2023/3/6		0.042	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/3/6			3,380	1,501	▲0.015		▲0.001	16.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/3/6			9,482	4,254	▲0.003		▲0.002	82.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/3/6			10,487	5,003	▲0.004		▲0.003	48.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/3/6			5,883	3,011	0.002		0.005	9.7
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/3/6			3,017	1,010	0.013		0.015	6.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)※4		2023/3/3	2023/3/6	▲1.100	18,242	16,681		▲1.100	▲3.540	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2023/3/3	2023/3/6	▲0.350	35,778	35,778		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2023/3/3	2023/3/6	▲0.350	11	11		▲0.350	▲0.350	

*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ター。
※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ター。※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ター。
※4国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)の売却銘柄は、利付国(10年)第367回(落札額10,499億円、応札額12,060億円)、368回(落札額6,182億円、応札額6,182億円)です。

◆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