

Central Daily Market Report

2023年3月17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17日 需給速報	2023年3月20日 需給予想	2023年3月22日 当社予想			
銀行券	100	0	▲ 1,000			
財政	▲ 3,600	82,400	2,000			
資金過不足	▲ 3,500	82,400	1,000			
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		▲ 500	▲ 100			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	78,300	▲ 35,900				
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	▲ 400	1,000		
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	▲ 43,800	48,400	50,000			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	42,900	131,900	2,000			
当座預金残高	5,261,900	5,393,800	5,395,800			
準備預金残高	4,600,400					
積み終了先	4,593,400			3月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,424,200			積数	42,700	
非準備預金先	661,500			1日平均	1,600	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					3,909,200	
準備預金進捗率	実績	98.91%	日数	12.90%		

●2023年3月17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▲0.04~▲0.005%近辺での調達で始まった。週末3日積みとなった事で調達ニーズの強まりも見られ、レート水準は前日比で上昇した。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、▲0.095~▲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>

17日はTB3M物(第1146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は、強含んで推移した。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。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

2023/3/17	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.016					-	▲ 0.090	0.270	▲ 0.014	27,333.79	323.18	133.35-39	133.01-03
T/N								-	▲ 0.096						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.005	▲ 0.014					-	▲ 0.115						
2W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.011					-	▲ 0.188						
3W								-	▲ 0.189						
1M			0.005					-	▲ 0.184						
3M			0.025					▲ 0.285	▲ 0.166						
6M								▲ 0.210	▲ 0.117						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.091						
日付		3/10	3/13	3/14	3/15	3/16									
日銀当預残	5,214,500	5,220,400	5,227,400	5,202,600	5,219,000										
準備預金残	4,558,900	4,568,000	4,580,100	4,595,300	4,553,600										
マネタリーベース	6,483,300	6,488,600	6,495,800	6,470,500	6,487,200										
無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.033%	▲0.033%	▲0.023%	▲0.021%										
コール市場残高	197,309	188,619	193,259	189,746	185,524										
うち無担	167,256	159,364	163,265	158,195	156,309										
うちO/N	89,988	89,346	92,847	91,207	93,411										
うち有担	30,053	29,255	29,994	31,551	29,215										

●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	1146	-	63,000	2023/3/20	2023/6/26	168,520.0	51,251.9	100.0595	▲0.2214%	23.3379%	100.0655	▲0.2437%	11,748.0

●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		2023/3/20		0.216	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		2023/3/20		0.332	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		2023/3/20		0.300	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/17	2023/3/20	▲1.100	6,104	6,104		▲1.100	▲2.483	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/17	2023/3/20	▲0.350	37,274	37,274		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/17	2023/3/20	▲1.100	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/17	2023/3/20	▲0.350	100	100		▲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国債補充供給(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(1,395億円)、368回(2,830億円)、369回(1,879億円)です。

●2023年3月20日の予定

*決定会合における主な意見(3月9、10日分)

◆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