

Central Daily Market Report

2023年3月22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22日 需給速報	2023年3月23日 需給予想	2023年3月24日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 1,000	1,000			
財政	▲ 3,400	16,700	10,000			
資金過不足	▲ 3,500	15,700	11,000			
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	8,500	▲ 6,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	13,200					
CP等買入		▲ 800	▲ 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	1,000		▲ 100			
新型コロナウイルス感染症支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 47,800	49,300	54,000			
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	13,400	70,400	11,000			
当座預金残高	5,350,900	5,421,300	5,432,300			
準備預金残高	4,679,000					
積み終了先	4,676,200			3月23日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,675,600			積数	28,200	
非準備預金先	671,900			1日平均	1,200	
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	99.28%	日数	22.58%		

●2023年3月22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▲0.03~▲0.005%近辺での調達で始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合いのみで本日の取引を終えた。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、▲0.10~▲0.085%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>

22日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、軟調な結果となった。マーケットで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

2023/3/22	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.091	0.323	0.088	27,466.61	520.94	132.39-41	132.59-61
T/N							-	▲ 0.096						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.003	▲ 0.030				-	▲ 0.114						
2W	▲ 0.027	▲ 0.018	▲ 0.022				-	▲ 0.198						
3W							-	▲ 0.196						
1M			0.015				-	▲ 0.189						
3M							▲ 0.285	▲ 0.174						
6M							▲ 0.210	▲ 0.122						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.096						
日付		3/14	3/15	3/16	3/17	3/20								
日銀当預残	5,227,400	5,202,600	5,219,000	5,261,900	5,337,500									
準備預金残	4,580,100	4,595,300	4,553,600	4,600,300	4,657,200									
マネタリーベース	6,495,800	6,470,500	6,487,200	6,530,000	6,605,600									
無担O/N加重平均	▲0.033%	▲0.023%	▲0.021%	▲0.016%	▲0.015%									
コール市場残高	193,259	189,746	185,524	205,935	196,992									
うち無担	163,265	158,195	156,309	174,854	166,775									
うちO/N	92,847	91,207	93,411	104,306	96,072									
うち有担	29,994	31,551	29,215	31,081	30,217									

●入札結果

本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/3/23			5,700	1,000		0.022	0.022	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/3/23		0.265	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		2023/3/23		0.357	0	0				
米ドル資金供給		2023/3/24	2023/3/30	5.040	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/3/22	2023/3/23	▲1.100	4,407	4,152		▲1.100	▲3.389	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/22	2023/3/23	▲0.350	42,929	42,929		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/22	2023/3/23	▲0.350	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/22	2023/3/23	▲3.000	255	255		▲3.000	▲3.000	

*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国債補充供給(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(落札額1,652億円、応札額1,652億円)、368回(落札額2,500億円、応札額2,755億円)です。

●2023年3月23日の予定

*2月の米新築一戸建て販売件数 *英中銀MPC結果発表	*流動性供給入札 (5,000億円、3/24発行)
--------------------------------	------------------------------

◆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