

Central Daily Market Report

2023年3月23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23日 需給速報	2023年3月24日 需給予想	2023年3月27日 当社予想			
銀行券	▲ 1,000	200	▲ 500			
財政	15,900	30,100	17,000			
資金過不足	14,900	30,300	16,500			
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						
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		▲ 200		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 100		▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F 買入			700			
国債補充供給	▲ 43,600	47,400		47,200		
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	19,400	77,700			16,500	
当座預金残高	5,370,300	5,448,000			5,464,500	
準備預金残高	4,684,300					
積み終了先	4,681,500			3月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,681,500			積数	25,500	
非準備預金先	686,000			1日平均	1,100	
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	99.35%	日数	25.81%		

●2023年3月23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。前日と比べ大きな変化は無く、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、▲0.115~▲0.095%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>

23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

2023/3/23	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	▲ 0.013					-	▲ 0.100	0.295	▲ 0.028	27,419.61	▲ 47.00	131.16-18	130.90-92
T/N								-	▲ 0.113						
S/N	▲ 0.005	0.001	▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.004	▲ 0.018					-	▲ 0.119						
2W	▲ 0.020	0.150	0.001					-	▲ 0.196						
3W			0.010					-	▲ 0.193						
1M			▲ 0.008					-	▲ 0.187						
3M								▲ 0.285	▲ 0.175						
6M								▲ 0.210	▲ 0.123						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.097						
日付		3/15	3/16	3/17	3/20	3/22									
日銀当預残	5,202,600	5,219,000	5,261,900	5,337,500	5,350,900										
準備預金残	4,595,300	4,553,600	4,600,300	4,657,200	4,678,900										
マネタリーベース	6,470,500	6,487,200	6,530,000	6,605,600	6,619,100										
無担O/N加重平均	▲0.023%	▲0.021%	▲0.016%	▲0.015%	▲0.014%										
コール市場残高	189,746	185,524	205,935	196,992	203,843										
うち無担	158,195	156,309	174,854	166,775	173,463										
うちO/N	91,207	93,411	104,306	96,072	101,710										
うち有担	31,551	29,215	31,081	30,217	30,380										

●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I非価格競争入札(億円)
流動性供給	378	-	5,000	2023/3/24	-	16,461.0	4,992.0		▲0.0310%	86.0674%		▲0.0370%	

●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		2023/3/24		0.177	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		2023/3/24		0.300	0	0				
米ドル資金供給		2023/3/27	2023/4/3	5.060	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/3/23	2023/3/24	▲1.100	3,808	3,361		▲1.100	▲4.251	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/23	2023/3/24	▲0.350	40,073	40,073		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/23	2023/3/24	▲0.350	0	0				

*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(午前オファー分)の売却銘柄は、利付国(10年)第367回(落札額1,361億円、応札額1,361億円)、368回(落札額2,000億円、応札額2,447億円)です。

●2023年3月24日の予定

*2月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.1%)	*2月の米耐久財新規受注	*国庫短期証券(1147回)入札 (3ヶ月、63,000億円、3/27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