

# Central Daily Market Report

2023年3月27日(月)  
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27日 需給速報	2023年3月28日 需給予想	2023年3月29日 当社予想			
銀行券	700	100	▲ 500			
財政	39,900	18,000	▲ 5,000			
資金過不足	40,600	18,100	▲ 5,500			
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 500		▲ 700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
新型コロナウイルス感染症 支援特別						
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 44,000	42,600		47,600		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	38,700	65,000		▲ 5,500		
当座預金残高	5,439,700	5,504,700		5,499,200		
準備預金残高	4,752,900					
積み終了先	4,751,100			3月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,751,100			積数	18,000	
非準備預金先	686,800			1日平均	900	
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	99.54%		日数	38.71%	

## ●2023年3月27日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末3日積み要因が剥落した事でレート水準は前営業日対比でやや低下した。立ち上がり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会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ものの、四半期末が近く出会い件数は限られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.20~▲0.10%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>

27日のアウトラ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

2023/3/27	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.149	0.290	0.010	27,476.87	91.62	130.84~86	130.92~93
T/N							-	▲ 0.197						
S/N							-	-						
1W	0.001	0.030	0.006				-	▲ 0.309						
2W			0.003				-	▲ 0.267						
3W							-	▲ 0.223						
1M							-	▲ 0.205						
3M							▲ 0.280	▲ 0.186						
6M							▲ 0.210	▲ 0.126						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.099						
日付		3/17	3/20	3/22	3/23	3/24								
日銀当預残	5,261,900	5,337,500	5,350,900	5,370,300	5,401,000									
準備預金残	4,600,300	4,657,200	4,678,900	4,685,500	4,720,100									
マネタリーベース	6,530,000	6,605,600	6,619,100	6,639,500	6,670,000									
無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.015%	▲0.014%	▲0.013%	▲0.009%									
コール市場残高	205,935	196,992	203,843	195,126	198,771									
うち無担	174,854	166,775	173,463	166,723	168,448									
うちO/N	104,306	96,072	101,710	93,670	96,095									
うち有担	31,081	30,217	30,380	28,403	30,323									

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第I非償債競争入札(億円)
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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/3/28		0.220	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		2023/3/28		0.330	0	0				
米ドル資金供給		2023/3/29	2023/4/5	5.050	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/3/27	2023/3/28	▲1.100	1,917	1,917		▲1.100	▲2.942	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/27	2023/3/28	▲0.350	41,792	41,792		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/27	2023/3/28	▲0.350	13	13		▲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定期利回較差の結果、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(705億円)、368回(1,212億円)です。

## ●2023年3月28日の予定

*1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	*40年利付国債入札(7,000億円、3/29発行)
*3月の米CB消費者信頼感指数	

◆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