

Central Daily Market Report

2023年3月28日(火)

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28日 需給速報	2023年3月29日 需給予想	2023年3月30日 当社予想			
銀行券	0	100	▲ 1,500			
財政	19,800	7,200	30,000			
資金過不足	19,800	7,300	28,500			
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		▲ 700		▲ 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						
新型コロナウイルス感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 39,400	44,000		43,100		
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	23,700	51,000		28,500		
当座預金残高	5,463,400	5,514,400		5,542,900		
準備預金残高	4,776,100					
積み終了先	4,774,600			3月29日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,774,600			積数	16,500	
非準備預金先				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	99.58%	日数	41.94%		

●2023年3月28日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、調達サイドからレートを引き下げる動きが若干見られたものの全体への影響は小さく、出合いの中心は前日比で概ね横這い圏での推移となった。立ち上がりは国内勢の調達を中心に▲0.035~▲0.005%近辺の出合いで始まった。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.02%近辺で散発的な出合いが見られた。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、四半期末が近く出合い件数は限られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.25~▲0.20%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>

28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、やや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発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート0.002%、平均落札レート0.018%と前回比(按分0.003%・平均0.013%)で按分は低下、平均は上昇となった。

●短期金融市場関連指標

2023/3/28	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	▲ 0.015					-	▲ 0.187	0.305	0.015	27,518.25	41.38	131.22-24	131.15-17
T/N								-	▲ 0.251						
S/N			0.001					-	-						
1W			0.130					-	▲ 0.360						
2W			0.005					-	▲ 0.296						
3W								-	▲ 0.239						
1M								-	▲ 0.213						
3M								▲ 0.280	▲ 0.190						
6M								▲ 0.210	▲ 0.128						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.100						
										日付	3/20	3/22	3/23	3/24	3/27
										日銀当預残	5,337,500	5,350,900	5,370,300	5,401,000	5,439,700
										準備預金残	4,657,200	4,678,900	4,685,500	4,720,100	4,752,900
										マネタリーベース	6,605,600	6,619,100	6,639,500	6,670,000	6,707,900
										無担O/N加重平均	▲0.015%	▲0.014%	▲0.013%	▲0.009%	▲0.014%
										コール市場残高	196,992	203,843	195,126	198,771	197,664
										うち無担	166,775	173,463	166,723	168,448	168,389
										うちO/N	96,072	101,710	93,670	96,095	95,636
										うち有担	30,217	30,380	28,403	30,323	29,275

●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)
40年利付国債	15	1.000%	7,000	2023/3/29	2062/3/20	18,855.0	6,999.0	86,2300	1.4650%	92.5781%			

●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*	申込総額(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	2023/3/29			2,625	1,000	0.012		0.012	50.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/3/29		0.210	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		2023/3/29		0.325	0	0				
米ドル資金供給		2023/3/30	2023/4/6	5.070	0	0				
CP等買入	4,000	2023/3/31			5,175	3,985	0.002		0.018	50.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/3/28	2023/3/29	▲1.200	1,501	1,501		▲1.200	▲2.218	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/28	2023/3/29	▲0.450	37,502	37,502		▲0.450	▲0.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/28	2023/3/29	▲0.450	153	153		▲0.450	▲0.450	

*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(451億円)、368回(1,050億円)です。

●2023年3月29日の予定

*特にありません

◆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