

Central Daily Market Report

2023年3月29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29日 需給速報	2023年3月30日 需給予想	2023年3月31日 当社予想			
銀行券	100	▲ 400	900			
財政	5,400	27,300	52,500			
資金過不足	5,500	26,900	53,400			
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		13,700				
CP等買入		▲ 400	▲ 500	4,000		
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対応金融支援特別 気候変動対応オペ						▲ 81,400
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 43,800	40,000	46,500			
※ドル資金供給用担保債提供額						
当預増減	2,300	86,600	▲ 24,000			
当座預金残高	5,465,700	5,552,300	5,528,300			
準備預金残高	4,782,300					
積み終了先	4,781,900			3月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,781,600			積数	15,800	
非準備預金先	683,400			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	99.60%	日数	45.16%		

●2023年3月29日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前日から大きな変化は無く、概ね横這い圏での出合いが中心となった。立ち上がりは国内勢の調達を中心に▲0.035~▲0.005%近辺の出合いが始まった。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。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.50~▲0.25%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>

29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発行市場は月末発行にあたり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

2023/3/29	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	売買参考統計値	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					-	▲ 0.191	0.300	▲ 0.005	27,883.78	365.53	131.04-05	131.97-99
T/N								-	▲ 0.331						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.015	0.010	▲ 0.009					-	▲ 0.414						
2W			▲ 0.020					-	▲ 0.321						
3W								-	▲ 0.261						
1M								-	▲ 0.230						
3M			0.008					▲ 0.280	▲ 0.190						
6M								▲ 0.210	▲ 0.129						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.100						
日付		3/22	3/23	3/24	3/27	3/28									
日銀当預残	5,350,900	5,370,300	5,401,000	5,439,700	5,463,400										
準備預金残	4,678,900	4,685,500	4,720,100	4,752,900	4,776,100										
マネタリーベース	6,619,100	6,639,500	6,670,000	6,707,900	6,731,600										
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.013%	▲0.009%	▲0.014%	▲0.015%										
コール市場残高	203,843	195,126	198,771	197,664	194,961										
うち無担	173,463	166,723	168,448	168,389	166,981										
うちO/N	101,710	93,670	96,095	95,636	93,938										
うち有担	30,380	28,403	30,323	29,275	27,980										

●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	募入競争入札(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		2023/3/30		0.195	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		2023/3/30		0.315	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/3/30			13,138	5,007	▲0.001		0.000	75.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/3/30			9,614	5,760	▲0.013		▲0.008	41.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/3/30			4,764	2,005	▲0.013		▲0.010	31.1
国債買入(物価連動債)	600	2023/3/30			1,543	601	▲0.220		▲0.536	10.9
米ドル資金供給		2023/3/31	2023/4/7	5.060	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/3/29	2023/3/30	▲1.300	1,430	1,430		▲1.300	▲2.125	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/29	2023/3/30	▲0.550	42,102	42,102		▲0.550	▲0.551	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/29	2023/3/30	▲0.550	0	0				

*オペの種類が、国債補完供給(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国債補完供給(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(256億円)、368回(1,174億円)です。

●2023年3月30日の予定

*10-12月期の米GDP確報値	*2年利付国債入札(29,000億円、4/3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