

Central Daily Market Report

2023年3月30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30日 需給速報	2023年3月31日 需給予想	2023年4月3日 当社予想			
銀行券	▲ 400	800	1,500			
財政	27,500	23,900	▲ 32,500			
資金過不足	27,100	24,700	▲ 31,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	13,700					
CP等買入		▲ 500	4,000	▲ 6,900		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ			51,900	▲ 81,400		
E T F買入						
国債補完供給	▲ 56,600	44,300	58,400			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	28,000	50,700	▲ 31,000			

●2023年3月30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なく、概ね横ばい圏での出合いが中心となった。立ち上がりは邦銀業態を中心に▲0.035~▲0.005%近辺の調達で始まった。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4月スタートの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、▲1.50~▲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>

30日のアウトライ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。

●2023年3月31日の予定

*3月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.1%)
*2月完全失業率(市場予想2.4%)
*2月の有効求人倍率(市場予想:1.36倍)
*2月の商業動態統計速報
*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+2.7%)
*2月の住宅着工統計
*2月の米個人所得・消費支出
*3月のシカゴPM景況感指数
*3月のユーロ圏消費者物価指数速報値
*10-12月期の英GDP改定値

当座預金残高	5,493,700	5,544,400	5,513,400	
準備預金残高	4,805,900			
積み終了先	4,805,500	3月31日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,805,300	積数	15,200	
非準備預金先	687,800	1日平均	1,000	
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	99.61%	日数	48.39%

●短期金融市場関連指標

2023/3/30	無担(速報)			有担(速報)			短期	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	▲ 0.014					-	▲ 0.328	0.315	0.015	27,782.93	▲ 100.85	132.53-56	132.40-42
T/N	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.002					-	▲ 1.205						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.024					-	▲ 0.639						
2W	▲ 0.020	▲ 0.001	▲ 0.015					-	▲ 0.478						
3W			0.001					-	▲ 0.356						
1M	▲ 0.012	0.000	▲ 0.010					-	▲ 0.276						
3M								▲ 0.280	▲ 0.197						
6M								▲ 0.210	▲ 0.130						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.101						
日付		3/23	3/24	3/27	3/28	3/29									
日銀当預残		5,370,300	5,401,000	5,439,700	5,463,400	5,465,700									
準備預金残		4,685,500	4,720,100	4,752,900	4,776,100	4,783,900									
マネタリーベース		6,639,500	6,670,000	6,707,900	6,731,600	6,733,800									
無担O/N加重平均		▲0.013%	▲0.009%	▲0.014%	▲0.015%	▲0.015%									
コール市場残高		195,126	198,771	197,664	194,961	191,622									
うち無担		166,723	168,448	168,389	166,981	164,754									
うちO/N		93,670	96,095	95,636	93,938	93,013									
うち有担		28,403	30,323	29,275	27,980	26,868									

●入札結果

名称	回数	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)
2年利付国債	447	0.005%	29,000	2023/4/3	2025/4/1	92,520.0	23,772.00	100.1250	▲0.0570%	6.3374%	100.1360	▲0.0630%	5,221.0

●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		2023/3/31		0.200	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		2023/3/31		0.325	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/3	2023/4/10	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		2023/3/30	2023/3/31	▲1.300	1,939	1,939		▲1.300	▲2.015	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/30	2023/3/31	▲0.550	54,320	54,320		▲0.550	▲0.552	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/30	2023/3/31	▲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、利付国債(10年)第367回(813億円)、368回(1,126億円)です。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)	(参考)2023/3/31時点の貸出残高(億円)	
新型コロナ対応金融支援特別	プロパー融資分	2023/3/31	2023/6/30	0	51,941	0
					制度融資分	0
					プロパー融資分	59,810
					合計	59,810

◆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