

Central Daily Market Report

2023年3月31日(金)

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31日 需給速報	2023年4月3日 需給予想	2023年4月4日 当社予想			
銀行券	800	600	1,000			
財政	24,000	▲ 33,400	▲ 16,000			
資金過不足	24,800	▲ 32,800	▲ 15,000			
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						
CP等買入	4,000	▲ 6,900		▲ 100		
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	51,900	▲ 81,400				
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 51,900	56,600		53,700		
※ドル資金供給用担保提供額						
当増増減	▲ 2,900	20,800		▲ 15,000		
当座預金残高	5,490,800	5,511,600		5,496,600		
準備預金残高	4,859,200					
積み終了先	4,859,100			4月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,854,400			積数	800	
非準備預金先	631,600			1日平均	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	99.98%		日数	58.06%	

●2023年3月31日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀を中心に▲0.05~▲0.01%近辺の出合いとなった。週末3日積みであったものの、年度末を跨ぐ取引となる事で調達を見送った先も多く、出合いレートは低下した。一巡後は▲0.05%前後の出合いが少額見られた程度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、▲0.15~▲0.10%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>

31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

2023/3/31	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.150	0.320	0.005	28,041.48	258.55	133.18-20	133.12-14
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.118						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.027	▲ 0.025	▲ 0.027				-	▲ 0.144						
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.149						
3W	0.040	0.050	0.045				-	▲ 0.159						
1M			▲ 0.020				-	▲ 0.171						
3M							▲ 0.250	▲ 0.179						
6M							▲ 0.160	▲ 0.129						
1Y							▲ 0.160	▲ 0.100						
日付	3/24	3/27	3/28	3/29	3/30									
日銀当預残	5,401,000	5,439,700	5,463,400	5,465,700	5,493,700									
準備預金残	4,720,100	4,752,900	4,776,100	4,783,900	4,805,800									
マネタリーベース	6,670,000	6,707,900	6,731,600	6,733,800	6,762,100									
無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.014%	▲ 0.015%	▲ 0.015%	▲ 0.014%									
コール市場残高	198,771	197,664	194,961	191,622	196,752									
うち無担	168,448	168,389	166,981	164,754	169,903									
うちO/N	96,095	95,636	93,938	93,013	97,567									
うち有担	30,323	29,275	27,980	26,868	26,849									

●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1非価格競争入札(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		2023/4/3		0.185	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		2023/4/3		0.295	0	0				
米ドル資金供給		2023/4/4	2023/4/11	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		2023/3/31	2023/4/3	▲ 2.200	1,845	1,845		▲ 2.200	▲ 2.886	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/31	2023/4/3	▲ 1.450	49,765	49,765		▲ 1.450	▲ 1.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/31	2023/4/3	▲ 1.450	40	40		▲ 1.450	▲ 1.460	

*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、利付国債(10年)第367回(813億円)、368回(1,032億円)です。

●2023年4月3日の予定

*3月調査の日銀短観(概要及び要旨) (市場予想:大企業・製造業の業況判断指数(DI)+3)	*3月のISM製造業景況指数 *2月の米建設支出	*国庫短期証券(1148回)入札 (3ヶ月、63,000億円、4/4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