

Central Daily Market Report

2023年3月20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20日 需給速報	2023年3月22日 需給予想	2023年3月23日 当社予想			
銀行券	▲ 100	▲ 100	500			
財政	81,800	2,400	5,000			
資金過不足	81,700	2,300	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			8,500	▲ 6,500		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			13,200			
国債買入						
CP等買入		▲ 100	▲ 800			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 400	1,000			
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						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 49,400	43,800	55,700			
米ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	75,600	73,400	5,500			
当座預金残高	5,337,500	5,410,900	5,416,400			
準備預金残高	4,663,600					
積み終了先	4,660,000			3月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,658,000			積数	31,600	
非準備預金先	673,900			1日平均	1,300	
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	99.19%	日数	19.35%		

●2023年3月20日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.03~▲0.005%近辺での調達で始まった。週末要因は剥落したものの、前週からの強含んだ地合いが継続し、引き続き高めのレート水準での出会いが中心となった。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、▲0.10~▲0.085%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>

20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、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。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

2023/3/20	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	▲ 0.068	0.001	▲ 0.015					-	▲ 0.090	0.235	▲ 0.035	26,945.67	▲ 388.12	132.27-29	131.04-07
T/N								-	▲ 0.097						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.020	▲ 0.005	▲ 0.008					-	▲ 0.115						
2W								-	▲ 0.198						
3W								-	▲ 0.195						
1M								-	▲ 0.190						
3M			0.025					▲ 0.285	▲ 0.173						
6M								▲ 0.210	▲ 0.120						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.095						
日付										3/13	3/14	3/15	3/16	3/17	
日銀当預残										5,220,400	5,227,400	5,202,600	5,219,000	5,261,900	
準備預金残										4,568,000	4,580,100	4,595,300	4,553,600	4,600,300	
マネタリーベース										6,488,600	6,495,800	6,470,500	6,487,200	6,530,000	
無担O/N加重平均										▲0.033%	▲0.033%	▲0.023%	▲0.021%	▲0.016%	
コール市場残高										188,619	193,259	189,746	185,524	205,935	
うち無担										159,364	163,265	158,195	156,309	174,854	
うちO/N										89,346	92,847	91,207	93,411	104,306	
うち有担										29,255	29,994	31,551	29,215	31,081	

●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		2023/3/22		0.230	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		2023/3/22		0.327	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/3/22		0.296	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/3/22			9,027	4,256	▲0.009		▲0.008	78.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/3/22			13,311	5,755	▲0.035		▲0.033	95.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/3/22			2,521	2,001	▲0.033		▲0.017	48.9
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2023/3/22			2,299	1,003	▲0.013		▲0.008	14.2
米ドル資金供給		2023/3/23	2023/3/30	4.940	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/20	2023/3/22	▲1.100	5,180	5,149		▲1.100	▲2.729	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/20	2023/3/22	▲0.350	43,822	43,822		▲0.350	▲0.355	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/3/22	2023/4/5	0.000	8,501	8,501				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/20	2023/3/22	▲1.100	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/20	2023/3/22	▲0.350	119	119		▲0.350	▲0.351	

*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。
※4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(落札額1,263億円・応札額1,263億円)・368回(落札額3,000億円・応札額3,031億円)・369回(落札額886億円・応札額886億円)です。

●2023年3月21日の予定

*春分の日	*米FOMC(1日目)	*2月の米中古住宅販売
-------	-------------	-------------

●2023年3月22日の予定

*月例経済報告	*米FOMC(2日目)	*FRB 米経済見通し発表	*2月の英消費者物価指数
---------	-------------	---------------	--------------

◆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