

Central Daily Market Report

2023年3月24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24日 需給速報	2023年3月27日 需給予想	2023年3月28日 当社予想			
銀行券	200	700	▲ 500			
財政	29,300	40,900	5,000			
資金過不足	29,500	41,600	4,500			
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						
国債買入						
CP等買入		▲ 400		▲ 500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 100				
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	700					
国債補充供給	▲ 42,600	43,600		46,200		
※ドル資金供給用担保提供額						
当預増減	30,700	87,300	4,500			
当座預金残高	5,401,000	5,488,300	5,492,800			
準備預金残高	4,720,100					
積み終了先	4,719,000			3月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,718,300			積数	19,800	
非準備預金先	680,900			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	99.49%	日数	35.48%		

●2023年3月24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▲0.025~▲0.003%近辺での調達で始まった。週末3日積みの取引となり、レート水準を一段引き上げての出会いとなった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみ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、▲0.13~▲0.105%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>

24日はTB3M物(第1147回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

<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

2023/3/24	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	▲ 0.055	0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.101	0.280	▲ 0.015	27,385.25	▲ 34.36	130.87-89	130.25-27
T/N								-	▲ 0.118						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.018	0.050	▲ 0.006					-	▲ 0.207						
2W								-	▲ 0.201						
3W								-	▲ 0.194						
1M								-	▲ 0.187						
3M			0.480					▲ 0.280	▲ 0.175						
6M								▲ 0.210	▲ 0.121						
1Y								▲ 0.160	▲ 0.097						
日付		3/16	3/17	3/20	3/22	3/23									
日銀当預残	5,219,000	5,261,900	5,337,500	5,350,900	5,370,300										
準備預金残	4,553,600	4,600,300	4,657,200	4,678,900	4,685,500										
マネタリーベース	6,487,200	6,530,000	6,605,600	6,619,100	6,639,500										
無担O/N加重平均	▲0.021%	▲0.016%	▲0.015%	▲0.014%	▲0.013%										
コーポ市場残高	185,524	205,935	196,992	203,843	195,126										
うち無担	156,309	174,854	166,775	173,463	166,723										
うちO/N	93,411	104,306	96,072	101,710	93,670										
うち有担	29,215	31,081	30,217	30,380	28,403										

●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)
国庫短期証券	1147	-	63,000	2023/3/27	2023/7/3	145,204.0	51,251.8	100.0595	▲0.2214%	72.2628%	100.0616	▲0.2292%	11,748.0

●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		2023/3/27		0.205	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		2023/3/27		0.325	0	0				
米ドル資金供給		2023/3/28	2023/4/4	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		2023/3/24	2023/3/27	▲1.100	2,733	2,733		▲1.100	▲3.734	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/24	2023/3/27	▲0.350	39,309	39,309		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/24	2023/3/27	▲0.350	276	276		▲0.350	▲0.350	

*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(905億円)、368回(1,828億円)です。

●2023年3月27日の予定

*2月の企業向けサービス価格指数
*1月の景気動向指数改訂状況

◆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