

# Central Daily Market Report

2023年3月9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9日 需給速報	2023年3月10日 需給予想	2023年3月13日 当社予想			
銀行券	▲ 300	500	▲ 1,000			
財政	600	▲ 100	▲ 2,000			
資金過不足	300	400	▲ 3,000			
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	27,700	1,600				
CP等買入		▲ 100	▲ 300	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				▲ 900		
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						
国債補完供給	▲ 58,400	47,500	68,000			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	17,000	68,800	1,000			
当座預金残高	5,210,800	5,279,600	5,280,600			
準備預金残高	4,550,800					
積み終了先	4,550,700			3月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,550,700			積数	300	
非準備預金先	660,000			1日平均	100	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						3,515,000
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	78.57%		

## ●2023年3月9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▲0.02~▲0.009%近辺での調達で始まった。積み進捗が順調に進むなか、レート水準はやや低下基調となっている。  
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、▲0.105~▲0.09%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>

9日はTB3M物(第1144回)の入札が実施され、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小じっかりと推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/3/9	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.092	0.500	0.000	28,623.15	178.96	137.20-23	136.83-85
T/N			▲ 0.012				-	▲ 0.099						
S/N			▲ 0.009				-	-						
1W							-	▲ 0.113						
2W							-	▲ 0.129						
3W			0.120				-	▲ 0.141						
1M			0.130				-	▲ 0.170						
3M							▲ 0.185	▲ 0.152						
6M							▲ 0.175	▲ 0.110						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.086						
日付		3/2	3/3	3/6	3/7	3/8								
日銀当預残	5,185,200	5,168,000	5,185,000	5,194,500	5,193,800									
準備預金残	4,534,700	4,513,500	4,519,500	4,538,300	4,534,900									
マネタリーベース	6,455,700	6,438,300	6,455,000	6,464,100	6,462,900									
無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.012%									
コール市場残高	201,049	211,843	204,806	217,141	213,721									
うち無担	171,829	182,042	176,575	186,381	182,230									
うちO/N	87,081	95,284	91,367	99,263	100,662									
うち有担	29,220	29,801	28,231	30,760	31,491									

## ●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	1144	-	63,000	2023/3/13	2023/6/19	136,976.0	51,251.8	100.0435	▲0.1619%	78.1372%	100.0532	▲0.1980%	11,748.0
流動性供給	377	-	5,000	2023/3/10	-	15,992.0	4,990.0	-	0.0000%	96.7889%	-	▲0.0030%	-
エネルギー対策	-	-	7,600	2023/3/20	2024/3/21	210,375.0	7,599.8	-	0.0000%	3.6126%	-	0.0000%	-

## ●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		2023/3/10		0.000	1,551	1,551				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/3/10		0.095	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		2023/3/10		0.050	0	0				
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分)※4		2023/3/9	2023/3/10	▲1.100	11,822	11,795		▲1.100	▲3.634	
国債補完供給(国債売現先・即日(午前オファー分)		2023/3/9	2023/3/10	▲0.350	44,860	44,860		▲0.350	▲0.364	
国債補完供給(国債売現先・即日(午後オファー分)		2023/3/9	2023/3/10	▲0.350	2,146	2,146		▲0.350	▲0.365	

\*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358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(落札額7,500億円、応札額7,527億円)、368回(落札額4,295億円、応札額4,295億円)です。

## ●2023年3月10日の予定

*日銀金融政策決定会合 (2日目、終了後直ちに結果公表)	*1月の全世帯家計調査 (市場予想:消費支出、前年比▲0.1%)	*1月の特定サービス産業動態統計速報	*2月の米財政収支
*黒田日銀総裁定例会見	*2月の企業物価指数		*2月の米雇用統計

◆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