

Central Daily Market Report

2023年3月10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10日 需給速報	2023年3月13日 需給予想	2023年3月14日 当社予想
銀行券	500	600	500
財政	▲200	1,600	▲2,000
資金過不足	300	2,200	▲1,500

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	1,600		800			
CP等買入		▲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						
国債補充供給	▲53,500	56,500	65,000			
※F T F 買入は国債補充供給に含める						

当増減	3,700	72,000	▲1,500
-----	-------	--------	--------

当座預金残高	5,214,500	5,286,500	5,285,000
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,560,300		
積み終了先	4,560,200	3月13日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,560,200	積数	100
非準備預金先	654,200	1日平均	0

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	100.00%	日数	89.29%
---------	----	---------	----	--------

●2023年3月10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▲0.04~▲0.02%近辺での調達で始まった。今積み期最後の週末となったが、進捗状況に目途が付き、調達を見送る先も散見された事で、レート水準は低下した。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

また、3月9~10日に開催された日銀金融政策決定会合では、現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%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>

10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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●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。

●2023年3月13日の予定

*1-3月期の法人企業景気予測調査季报

●短期金融市場関連指標

2023/3/10	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	
	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	▲0.070	0.001	▲0.029				-	▲0.093	0.390	▲0.110	28,143.97	▲479.18	136.36-39	136.40-43
T/N							-	▲0.100						
S/N			▲0.009				-	-						
1W	▲0.023	▲0.018	▲0.019				-	▲0.117						
2W			▲0.005				-	▲0.128						
3W							-	▲0.164						
1M			0.150				-	▲0.174						
3M							▲0.195	▲0.156						
6M							▲0.180	▲0.109						
1Y							▲0.096	▲0.086						

日付	3/3	3/6	3/7	3/8	3/9
日銀当預残	5,168,000	5,185,000	5,194,500	5,193,800	5,210,800
準備預金残	4,513,500	4,519,500	4,538,300	4,534,900	4,549,900
マネタリーベース	6,438,300	6,455,000	6,464,100	6,462,900	6,480,200
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.012%	▲0.017%
コール市場残高	211,843	204,806	217,141	213,721	213,606
うち無担	182,042	176,575	186,381	182,230	183,129
うちO/N	95,284	91,367	99,263	100,662	102,581
うち有担	29,801	28,231	30,760	31,491	30,477

●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		2023/3/13		0.000	800	800				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/3/13		0.065	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		2023/3/13		0.015	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/10	2023/3/13	▲1.100	17,214	16,133		▲1.100	▲3.373	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/10	2023/3/13	▲0.350	37,721	37,721		▲0.350	▲0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※5		2023/3/13		0.000	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※6		2023/3/13		0.065	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※7		2023/3/13		0.015	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/10	2023/3/13	▲1.100	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/10	2023/3/13	▲0.350	164	164		▲0.350	▲0.359	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/10	2023/3/13	▲3.000	15	15		▲3.000	▲3.000	

*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※5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※6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※7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7,000億円、応札額7,757億円)、368回(落札額4,499億円、応札額4,823億円)、369回(落札額4,634億円、応札額4,634億円)です。

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

- 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。
 - 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(全員一致)
 - 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。

短期金利：日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利：10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
 - 長短金利操作の運用
長期金利の変動幅を「±0.5%程度」とし、10年物国債金利について0.5%の利回りで指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。上記の金融市場調節方針と整合的なイールドカーブの形成を促すため、大規模な国債買入れを継続するとともに、各年限において、機動的に、買入れ額の増額や指値オペを実施する。
 - 資産買入れ方針(全員一致)
長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
 - E T F および J - R E I T について、それぞれ年間約1兆2兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
 - C P 等は、約2兆円の残高を維持する。社債等は、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(約3兆円)へと徐々に戻していく。ただし、社債等の買入れ残高の調整は、社債の発行環境に十分配慮して進めることとする。

◆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預り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