

Central Daily Market Report

2023年3月13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13日 需給速報	2023年3月14日 需給予想	2023年3月15日 当社予想			
銀行券	700	▲ 300	1,000			
財政	1,400	3,400	▲ 25,000			
資金過不足	2,100	3,100	▲ 24,000			
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			1,000			
国債買入	800					
CP等買入	4,000		▲ 300			
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感染症 気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 53,200	52,200	64,600			
当預増減	5,900	68,400	▲ 24,000			
当座預金残高	5,220,400	5,288,800	5,264,800			
準備預金残高	4,568,000					
積み終了先	4,568,000			3月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,568,000			積数	0	
非準備預金先	652,400			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	92.86%		

●2023年3月13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。積み期終盤となり、ビッドサイドには調達量を制限する動きも見られたなか、レート水準は、前営業日比で横這いからやや低下しての推移となった。
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~▲0.09%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>

13日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、強い結果となった。マーケットで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発行市場は複数の発行が観測され、一部で大型発行も見られた。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

2023/3/13	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.033				-	▲ 0.093	0.300	▲ 0.090	27,832.96	▲ 311.01	134.95-99	134.49-52
T/N							-	▲ 0.099						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.040				-	▲ 0.115						
2W	▲ 0.020	0.008	▲ 0.006				-	▲ 0.128						
3W							-	▲ 0.176						
1M			0.010				-	▲ 0.179						
3M	0.025	0.040	0.028				▲ 0.195	▲ 0.154						
6M							▲ 0.180	▲ 0.108						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.086						
日付	3/6	3/7	3/8	3/9	3/10									
日銀当預残	5,185,000	5,194,500	5,193,800	5,210,800	5,214,500									
準備預金残	4,519,500	4,538,300	4,534,900	4,549,900	4,558,900									
マネタリーベース	6,455,000	6,464,100	6,462,900	6,480,200	6,483,300									
無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.011%	▲0.012%	▲0.017%	▲0.029%									
コール市場残高	204,806	217,141	213,721	213,606	197,309									
うち無担	176,575	186,381	182,230	183,129	167,256									
うちO/N	91,367	99,263	100,662	102,581	89,988									
うち有担	28,231	30,760	31,491	30,477	30,053									

●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。

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/3/14			1,600	1,000		0.004	0.004	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)(※1)		2023/3/14		0.110	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)		2023/3/14		0.151	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)		2023/3/14		0.105	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)(※4)		2023/3/13	2023/3/14	▲1.100	13,940	13,940		▲1.100	▲3.451	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/13	2023/3/14	▲0.350	39,022	39,022		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/13	2023/3/14	▲1.100	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/13	2023/3/14	▲0.350	419	419		▲0.350	▲0.352	

*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(6,414億円)、368回(3,430億円)、369回(4,096億円)です。

●2023年3月14日の予定

*2月の米消費者物価指数

*5年利付国債入札
(25,000億円、3/15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