

Central Daily Market Report

2023年3月15日(水)

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15日 需給速報	2023年3月16日 需給予想	2023年3月17日 当社予想			
銀行券	500	▲ 300	▲ 1,500			
財政	▲ 21,700	3,200	▲ 4,000			
資金過不足	▲ 21,200	2,900	▲ 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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		15,600				
CP等買入	▲ 400	▲ 500				
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			78,300	▲ 37,700		
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						
国債補完供給	▲ 46,300	43,200	57,800			
※ドル資金供給用担保債提供						
当増減	▲ 24,800	75,800	35,100			
当座預金残高	5,202,600	5,278,400	5,313,500			
準備預金残高	4,594,600					
積み終了先	4,594,600			3月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,594,600			積数	3,909,200	
非準備預金先	608,000			1日平均	126,100	
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	0.00%	日数	0.00%		

●2023年3月15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~▲0.01%近辺での調達で始まった。積み最終日となり、ビッドサイドは着地に向けた調整から取り上げる先が多く見られ、レート水準は前日に比べ上昇して推移した。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

<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>

15日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物と3M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは横ばい圏での推移となった。

●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。

●短期金融市場関連指標

2023/3/15	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.023					-	▲ 0.091	0.320	0.043	27,229.48	7.44	134.42-45	134.86-89
T/N								-	▲ 0.097						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.003	▲ 0.026					-	▲ 0.117						
2W			▲ 0.020					-	▲ 0.132						
3W								-	▲ 0.187						
1M			0.030					-	▲ 0.182						
3M			0.011					▲ 0.250	▲ 0.161						
6M								▲ 0.190	▲ 0.109						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.086						
日付		3/8	3/9	3/10	3/13	3/14									
日銀当預残	5,193,800	5,210,800	5,214,500	5,220,400	5,227,400										
準備預金残	4,534,900	4,549,900	4,558,900	4,568,000	4,580,100										
マネタリーベース	6,462,900	6,480,200	6,483,300	6,488,600	6,495,800										
無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.017%	▲0.029%	▲0.033%	▲0.033%										
コール市場残高	213,721	213,606	197,309	188,619	193,259										
うち無担	182,230	183,129	167,256	159,364	163,265										
うちO/N	100,662	102,581	89,988	89,346	92,847										
うち有担	31,491	30,477	30,053	29,255	29,994										

●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)	投分レート ・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	投分 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		2023/3/16		0.223	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		2023/3/16		0.291	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		2023/3/16		0.260	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/3/16			4,987	4,250	▲0.019		▲0.009	46.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/3/16			9,047	5,002	▲0.008		▲0.005	70.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/3/16			14,342	5,754	▲0.002		0.005	17.9
国債買入(残存期間25年超)	500	2023/3/16			2,350	503	0.110		0.116	22.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/15	2023/3/16	▲1.100	9,395	9,395		▲1.100	▲2.445	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/15	2023/3/16	▲0.350	36,496	36,496		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/15	2023/3/16	▲1.100	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/15	2023/3/16	▲0.350	186	186		▲0.350	▲0.353	

*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(3,021億円)、368回(3,179億円)、369回(3,195億円)です。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)	
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2023/3/17	2027/3/17	0	78,260

●2023年3月16日の予定

*1月の機械受注統計 (市場予想: 船舶・電力除く民需、前月比+1.8%)	*2月の米住宅着工件数 *ECB定例理事会(金融政策発表)	*国庫短期証券(1145回)入札 (1年、35,000億円、3/20発行)
*2月の貿易統計		*20年利付国債入札(12,000億円、3/17発行)

◆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