

# Central Daily Market Report

2023年3月16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16日 需給速報	2023年3月17日 需給予想	2023年3月20日 当社予想			
銀行券	▲ 200	0	▲ 1,000			
財政	2,200	▲ 3,300	81,000			
資金過不足	2,000	▲ 3,300	80,000			
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	15,600					
CP等買入		▲ 500	▲ 500			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)			78,300	▲ 35,900		
被災地支援 社債等買入				▲ 100		
新型コロナウイルス感染症支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 48,600	47,900	55,600			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	16,400	94,100	80,000			
当座預金残高	5,219,000	5,313,100	5,393,100			
準備預金残高	4,553,900					
積み終了先	2,978,700			3月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,216,700			積数	572,000	
非準備預金先	665,100			1日平均	19,100	
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	85.37%	日数	3.23%		

## ●2023年3月16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~▲0.01%近辺での調達で始まった。積み初日となり、レート目線が定まり辛いなか、大手行からは▲0.03%前後、地銀業態からは▲0.02%前後での出会いが中心となった事で、出会いのレンジはややワイド化する展開となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。  
なお、今積み期はマクロ加算残高にかかる基準比率が68.0%に設定されたことや、貸出増加支援オペの利用増加により、マクロ加算残高枠の増加が見込まれている。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.08%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>

16日はTB1Y物(第1145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は、しっかり推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートに目立った変化は見られなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/3/16	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.021					-	▲ 0.090	0.284	▲ 0.036	27,010.61	▲ 218.87	132.89-92	133.10-13
T/N								-	▲ 0.097						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.015	▲ 0.022					-	▲ 0.117						
2W	▲ 0.020	▲ 0.008	▲ 0.016					-	▲ 0.135						
3W								-	▲ 0.190						
1M								-	▲ 0.183						
3M								▲ 0.250	▲ 0.162						
6M								▲ 0.190	▲ 0.111						
1Y								▲ 0.140	▲ 0.087						
日付		3/9	3/10	3/13	3/14	3/15									
日銀当預残	5,210,800	5,214,500	5,220,400	5,227,400	5,202,600										
準備預金残	4,549,900	4,558,900	4,568,000	4,580,100	4,595,300										
マネタリーベース	6,480,200	6,483,300	6,488,600	6,495,800	6,470,500										
無担O/N加重平均	▲0.017%	▲0.029%	▲0.033%	▲0.033%	▲0.023%										
コール市場残高	213,606	197,309	188,619	193,259	189,746										
うち無担	183,129	167,256	159,364	163,265	158,195										
うちO/N	102,581	89,988	89,346	92,847	91,207										
うち有担	30,477	30,053	29,255	29,994	31,551										

## ●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1145	-	35,000	2023/3/20	2024/3/21	109,250.0	28,476.7	100.1120	▲0.1112%	45.5353%	100.1260	▲0.1251%	6,523.0
20年利付国債	183	1.400%	12,000	2023/3/17	2042/12/20	27,817.0	9,774.00	104.5500	1.1180%	41.4285%	105.2200	1.0790%	2,225.0

## ●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		2023/3/17		0.180	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		2023/3/17		0.275	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		2023/3/17		0.240	0	0				
社債等買入	1,000	2023/3/22			2,121	1,000	0.243		0.279	64.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/16	2023/3/17	▲1.100	8,921	8,921		▲1.100	▲2.278	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/16	2023/3/17	▲0.350	39,490	39,490		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/16	2023/3/17	▲1.100	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/16	2023/3/17	▲0.350	62	62		▲0.350	▲0.360	

\*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(2,904億円)、368回(3,017億円)、369回(3,000億円)です。

## ●2023年3月17日の予定

*10-12月期の資金循環統計速報	*2月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1146回)入札
*1月の第3次産業活動指数	*3月のミシガン大消費者信頼感指数速報	(3ヶ月、63,000億円、3/20発行)
	*2月のユーロ圏消費者物価指数改定値	

◆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