

# Central Daily Market Report

2023年3月6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6日 需給速報	2023年3月7日 需給予想	2023年3月8日 当社予想			
銀行券	300	400	500			
財政	▲ 300	3,700	▲ 9,000			
資金過不足	0	4,100	▲ 8,500			
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						▲ 4,300
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	17,700		2,700			
CP等買入		▲ 200		▲ 100		
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	▲ 50,000	49,500		61,900		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	17,000	68,600				▲ 12,800
当座預金残高	5,185,000	5,253,600				5,240,800
準備預金残高	4,521,000					
積み終了先	4,520,800			3月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,520,800			積数		600
非準備預金先	664,000			1日平均		100
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						3,518,100
準備預金進捗率	実績	99.98%		日数		67.86%

## ●2023年3月6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▲0.01~▲0.008%近辺での調達で始まった。週末要因が剥落した事により、ビッド水準を僅かに低下させた先も見られたが、概ね前営業日から横這い圏での推移となった。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~▲0.085%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>

6日のアウトライト市場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発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/3/6	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.011				-	▲ 0.092	0.500	0.000	28,237.78	310.31	136.00-03	135.67-70
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.102						
S/N			▲ 0.008				-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.009	▲ 0.034				-	▲ 0.108						
2W							-	▲ 0.116						
3W			0.001				-	▲ 0.130						
1M							-	▲ 0.154						
3M							▲ 0.185	▲ 0.150						
6M							▲ 0.145	▲ 0.108						
1Y							▲ 0.096	▲ 0.084						
日付		2/27	2/28	3/1	3/2	3/3								
日銀当預残	5,239,800	5,248,800	5,235,500	5,185,200	5,168,000									
準備預金残	4,599,900	4,587,700	4,586,900	4,534,700	4,513,500									
マネタリーベース	6,509,100	6,518,400	6,505,300	6,455,700	6,438,300									
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.010%									
コール市場残高	189,486	202,956	200,667	201,049	211,843									
うち無担	160,383	175,490	170,381	171,829	182,042									
うちO/N	85,795	100,752	91,793	87,081	95,284									
うち有担	29,103	27,466	30,286	29,220	29,801									

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/3/7		0.000	2,650	2,650				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/3/7		0.100	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		2023/3/7		0.055	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/6	2023/3/7	▲1.100	13,223	13,223		▲1.100	▲4.005	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/6	2023/3/7	▲0.350	37,020	37,020		▲0.350	▲0.401	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/6	2023/3/7	▲0.350	61	61		▲0.350	▲0.350	

\*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(8,200億円)、368回(5,023億円)です。

## ●2023年3月7日の予定

*2月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*1月の米卸売売上高	*30年利付国債入札(9,000億円、3/8発行)
*1月の毎月勤労統計調査速報	*1月の米消費者信用残高	

◆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