

Central Daily Market Report

2023年2月1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2月1日 需給速報	2023年2月2日 需給予想	2023年2月3日 当社予想			
銀行券	700	0	500			
財政	▲ 37,700	▲ 84,000	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 37,000	▲ 84,000	▲ 26,500			
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	10,000					
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入	400					
CP等買入			▲ 200			
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	▲ 70,000	73,400		70,000		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	▲ 22,200	▲ 14,200	▲ 26,500			
当座預金残高	5,225,400	5,211,200	5,184,700			
準備預金残高	4,549,400					
積み終了先	4,548,800			2月2日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,548,500			積数	3,800	
非準備預金先	676,000			1日平均	300	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,910,200	
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数	54.84%		

●2023年2月1日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.012~▲0.01%近辺での出会いとなった。引き続き調達ニーズが強い中、ビッド数が増加した事により、レート水準はやや上昇する展開となった。
ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.095%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>

1日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、1Y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、発行レートは概ね横這い圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/2/1	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	▲ 0.013					-	▲ 0.099	0.480	▲ 0.010	27,346.88	19.77	130.11-13	130.17-18
T/N								-	▲ 0.101						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023					-	▲ 0.116						
2W	▲ 0.030	0.040	▲ 0.018					-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.137						
1M								-	▲ 0.144						
3M								▲ 0.172	▲ 0.144						
6M								▲ 0.115	▲ 0.103						
1Y								▲ 0.100	▲ 0.079						
										日付	1/25	1/26	1/27	1/30	1/31
										日銀当預残	5,178,700	5,212,100	5,202,800	5,226,000	5,247,600
										準備預金残	4,516,100	4,546,200	4,547,200	4,556,700	4,584,300
										マネタリーベース	6,451,100	6,485,000	6,475,200	6,497,800	6,519,000
										無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%
										コール市場残高	199,873	205,801	202,358	200,302	190,647
										うち無担	171,009	173,553	172,193	170,786	165,187
										うちO/N	101,563	103,507	100,247	98,840	102,386
										うち有担	28,864	32,248	30,165	29,516	25,460

●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I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		2023/2/2		0.010	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		2023/2/2		0.091	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/1	2023/2/2	▲0.350	70,448	70,274		▲0.350	▲0.360	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/1	2023/2/2	▲0.350	319	319		▲0.350	▲0.358	

*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。

●2023年2月2日の予定

*1月のマネタリーベース	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*10年利付国債入札
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*英中銀MPC結果発表	(27,000億円、2/3発行)
	*12月の米製造業新規受注・出荷・在庫	

◆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