Central Daily Market Report

2023年2月2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2月2日 需給速報		2023年2月3日 需給予想		2023年2月6日 当社予想	
銀行券	100		1,000		1,500	
財政	▲ 84,100		▲ 31,300		2,000	
資金過不足	▲ 84,000		▲ 30,300		3,500	
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						
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						
新型コロナ対応金融支援特別						
気候変動対応オペ						
ＥＴＦ買入						
国債補完供給	▲ 67,800	70,000		67,800		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	▲ 82,000		37,400		3,500	

当座預金残高	5,143,400	5,180,800	5,184,300
準備預金残高	4,472,000		
積み終了先	4,471,600	2月3日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,471,600	積数	3,400
非準備預金先	671,400	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 99.91%	日数	58.06%

●2023年2月2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%近辺での出合いとなった。引き続き調達ニーズが強く、レート水準は前日比で横這い圏での推移となった。
ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>
GC T/Nは、▲0.11～▲0.10%程度での出合いとなった。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>
2日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、特段の出合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、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

2023/2/2	無担（速報）			有担（速報）			短国	東京レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.013				－	▲ 0.100
T/N							－	▲ 0.106
S/N			▲ 0.005				－	－
1W			0.008				－	▲ 0.118
2W	▲ 0.030	▲ 0.012	▲ 0.023				－	▲ 0.127
3W							－	▲ 0.136
1M	▲ 0.020	0.160	0.006				－	▲ 0.146
3M							▲ 0.172	▲ 0.145
6M							▲ 0.115	▲ 0.103
1Y							▲ 0.110	▲ 0.080

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替（9時）	為替（17時）
0.495	0.015	27,402.05	55.17	128.60-62	128.65-67

日付	1/26	1/27	1/30	1/31	2/1
日銀当預残	5,212,100	5,202,800	5,226,000	5,247,600	5,225,400
準備預金残	4,546,200	4,547,200	4,556,700	4,584,300	4,549,400
マネタリーベース	6,485,000	6,475,200	6,497,800	6,519,000	6,496,100
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.013%
コール市場残高	205,801	202,358	200,302	190,647	202,258
うち無担	173,553	172,193	170,786	165,187	174,928
うちO/N	103,507	100,247	98,840	102,386	109,727
うち有担	32,248	30,165	29,516	25,460	27,330

●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)	非競争入札(億円)
10年利付国債	369	0.50%	27,000	2023/2/3	2032/12/20	104,132.0	22,582.00	100.0400	**0.4950%**	**58.5171%**	100.1400	**0.4850%**	4,409.0	3.01

●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		2023/2/3		0.020	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		2023/2/3		0.111	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2023/2/2	2023/2/3	▲0.350	68,107	67,125		▲0.350	▲0.374	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2023/2/2	2023/2/3	▲0.350	994	994		▲0.350	▲0.351	

*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3日の予定

*2月の日銀当座預金増減要因見込み
*1月の米雇用統計
*1月のISM非製造業景況指数
*国庫短期証券(1136回)入札（3ヶ月、60,000億円、2/6発行）
*交付税特別会計借入（12,000億円、2/15借入）

◆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。
◆本資料は何ら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論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