

Central Daily Market Report

2023年2月3日(金)

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3日 需給速報	2023年2月6日 需給予想	2023年2月7日 当社予想			
銀行券	1,100	600	1,000			
財政	▲ 30,700	6,200	3,000			
資金過不足	▲ 29,600	6,800	4,000			
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		15,900				
CP等買入		▲ 100	▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 58,500	67,800		58,500		
※ドル資金供給用担保債提供						
当預増減	▲ 20,400	81,100	4,000			
当座預金残高	5,123,000	5,204,100	5,208,100			
準備預金残高	4,454,500					
積み終了先	4,454,100			2月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,454,100			積数	2,300	
非準備預金先	668,500			1日平均	200	
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	99.94%	日数	67.74%		

●2023年2月3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▲0.01%近辺での出合いとなった。週末3日積みとなった事から、調達ニーズが強まった先も散見され、レート水準は若干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、▲0.105~▲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>

3日は、TB3M物(第1136回)の入札が実施され、大方の事前予想通り、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、しっかりと推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の発行が観測され、発行レートは概ね横這い圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/2/3	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	▲ 0.012					-	▲ 0.102	0.484	▲ 0.011	27,509.46	107.41	128.76-78	128.59-62
T/N								-	▲ 0.106						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W			▲ 0.035					-	▲ 0.118						
2W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.017					-	▲ 0.126						
3W			▲ 0.005					-	▲ 0.136						
1M			0.000					-	▲ 0.146						
3M			0.020					▲ 0.180	▲ 0.144						
6M								▲ 0.115	▲ 0.103						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.080						
										日付	1/27	1/30	1/31	2/1	2/2
										日銀当預残	5,202,800	5,226,000	5,247,600	5,225,400	5,143,400
										準備預金残	4,547,200	4,556,700	4,584,300	4,549,400	4,472,400
										マネタリーベース	6,475,200	6,497,800	6,519,000	6,496,100	6,414,000
										無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.013%	▲ 0.013%
										コール市場残高	202,358	200,302	190,647	202,258	207,099
										うち無担	172,193	170,786	165,187	174,928	179,939
										うちO/N	100,247	98,840	102,386	109,727	113,518
										うち有担	30,165	29,516	25,460	27,330	27,160

●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1非債務競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1136	-	60,000	2023/2/6	2023/5/15	160,669.0	48,809.2	100.0400	▲0.1489%	16.2677%	100.0427	▲0.1589%	11,190	
交付税特会	-	-	12,000	2023/2/15	2023/8/15	415,785.0	11,990.17		0.0000%	2.8838%		0.0000%		10.00

●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		2023/2/6		0.005	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		2023/2/6		0.115	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/2/6			4,490	1,502	▲0.009		▲0.006	78.3
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/2/6			8,507	4,252	▲0.015		▲0.011	45.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/2/6			9,200	5,003	▲0.013		▲0.010	54.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/2/6			5,250	3,004	▲0.031		▲0.027	73.4
国債買入(残存期間25年超)	2,000	2023/2/6			3,173	2,003	▲0.004		▲0.002	40.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/3	2023/2/6	▲0.350	58,968	58,968		▲0.350	▲0.352	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/3	2023/2/6	▲0.350		0				

*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6日の予定

*特にありません
◆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