

Central Daily Market Report

2023年2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2月6日 需給速報	2023年2月7日 需給予想	2023年2月8日 当社予想			
銀行券	700	1,000	1,000			
財政	5,000	1,200	▲ 9,000			
資金過不足	5,700	2,200	▲ 8,000			
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						▲ 5,800
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		▲ 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	▲ 58,800	55,400		58,800		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	18,100	60,800		▲ 13,800		
当座預金残高	5,141,100	5,201,900		5,188,100		
準備預金残高	4,474,600					
積み終了先	4,473,300			2月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,473,300			積数	1,000	
非準備預金先	666,500			1日平均	100	
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	99.97%		日数	70.97%	

●2023年2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、邦銀業態からの調達を中心に▲0.04%~▲0.012%程度の調達で始まった。大手行からのビッドが入らなかった事で、レート水準は前営業日に比べ低下する展開となった。
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、3M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、案件に乏しく閑散としたマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/2/6	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	▲ 0.021					-	▲ 0.100	0.490	0.006	27,693.65	184.19	132.06-07	131.78-80
T/N								-	▲ 0.107						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.010	▲ 0.023					-	▲ 0.116						
2W			▲ 0.028					-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.135						
1M			0.100					-	▲ 0.147						
3M								▲ 0.180	▲ 0.146						
6M								▲ 0.115	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.084						
										日付	1/30	1/31	2/1	2/2	2/3
										日銀当預残	5,226,000	5,247,600	5,225,400	5,143,400	5,123,000
										準備預金残	4,556,700	4,584,300	4,549,400	4,472,400	4,454,900
										マネタリーベース	6,497,800	6,519,000	6,496,100	6,414,000	6,392,500
										無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.012%
										コール市場残高	200,302	190,647	202,258	207,099	197,573
										うち無担	170,786	165,187	174,928	179,939	170,535
										うちO/N	98,840	102,386	109,727	113,518	103,544
										うち有担	29,516	25,460	27,330	27,160	27,038

●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		2023/2/7		0.016	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		2023/2/7		0.146	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/6	2023/2/7	▲ 0.350	58,956	58,956		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/6	2023/2/7	▲ 0.350		32		▲ 0.350	▲ 0.350	

*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7日の予定

*12月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲0.2%)	*12月の米貿易収支	*30年利付国債入札(9,000億円、2/8発行)
*12月の毎月勤労統計調査速報	*12月の米消費者信用残高	*エネルギー対策借入(6,400億円、2/20借入)
*1月のマネタリーベースと日本銀行の取引		
*12月の景気動向指数速報		

◆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