

Central Daily Market Report

2023年2月8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8日 需給速報	2023年2月9日 需給予想	2023年2月10日 当社予想			
銀行券	500	300	500			
財政	▲ 7,300	▲ 100	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 6,800	200	▲ 4,500			
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	2,800	▲ 5,800				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入	100		19,200			
CP等買入		▲ 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感染症 気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 54,200	53,500		54,200		
※ドル資金供給用担保提供特約						
当増増減	▲ 9,500		73,600		▲ 4,500	
当座預金残高	5,138,400		5,212,000		5,207,500	
準備預金残高	4,476,700					
積み終了先	4,476,600					
超過準備	4,476,600					
非準備預金先	661,700					
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額						3,906,000
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	77.42%		

●2023年2月8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▲0.05~▲0.03%近辺の調達で始まった。レート水準は引き続き低下基調となっており、一巡後は▲0.05~▲0.04%近辺で散発的な出会いとなった。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>

8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、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートに目立った変化は見られなかった。また、本日はCP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分落札レート0.003%、平均落札レート0.006%と前回(按分落札レート0.005%・平均落札レート0.029%)比で按分・平均ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2023/2/8	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	▲ 0.073	0.001	▲ 0.035					-	▲ 0.101	0.490	0.000	27,606.46	▲ 79.01	131.05-07	130.88-90
T/N			▲ 0.008					-	▲ 0.107						
S/N			▲ 0.010					-	-						
1W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.116						
2W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.034					-	▲ 0.127						
3W			▲ 0.030					-	▲ 0.139						
1M			▲ 0.008					-	▲ 0.147						
3M								▲ 0.177	▲ 0.146						
6M								▲ 0.115	▲ 0.107						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.082						
日付		2/1	2/2	2/3	2/6	2/7									
日銀当預残	5,225,400	5,143,400	5,123,000	5,141,100	5,147,900										
準備預金残	4,549,400	4,472,400	4,454,900	4,473,800	4,475,100										
マナターベース	6,496,100	6,414,000	6,392,500	6,409,900	6,415,600										
無担O/N加重平均	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.021%	▲ 0.029%										
コール市場残高	202,258	207,099	197,573	181,782	178,643										
うち無担	174,928	179,939	170,535	152,823	151,888										
うちO/N	109,727	113,518	103,544	87,361	85,976										
うち有担	27,330	27,160	27,038	28,959	26,755										

●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		2023/2/9		0.010	105	105				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/9		0.115	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/2/9			9,235	4,256	▲0.007		▲0.006	95.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/2/9			9,413	5,008	▲0.005		▲0.004	85.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/2/9			13,762	6,758	▲0.004		▲0.003	99.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/2/9			4,830	3,005	▲0.009		▲0.005	8.8
CP等買入	4,000	2023/2/13			7,065	3,965	0.003		0.006	90.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/8	2023/2/9	▲0.350	53,445	53,445		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/8	2023/2/9	▲0.350	1,067	1,067		▲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9日の予定

*1月のマネーストック	*国庫短期証券(1137回)入札	*10年物価連動国債
*12月の特定サービス産業動態統計速報	(6ヶ月、45,000億円、2/10発行)	(2,500億円、2/10発行)

◆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