

# Central Daily Market Report

2023年2月9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9日 需給速報	2023年2月10日 需給予想	2023年2月13日 当社予想			
銀行券	400	200	500			
財政	400	▲ 4,200	2,000			
資金過不足	800	▲ 4,000	2,500			
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	19,200	300				
CP等買入			▲ 500	4,000		
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	▲ 55,100	52,000	55,100			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	16,900	50,900	6,500			
当座預金残高	5,155,300	5,206,200	5,212,700			
準備預金残高	4,488,500					
積み終了先	4,488,500			2月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,488,400			積数	200	
非準備預金先	666,800			1日平均	0	
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	80.65%		

## ●2023年2月9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~▲0.03%近辺の調達で始まった。一巡後はレート水準がやや低下したものの、前日と同様に▲0.05~▲0.04%近辺ではビッドが底堅く推移する展開となった。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>

9日はTB6M物(第1137回)の入札が実施され、やや強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは横這い圏での推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/2/9	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	▲ 0.036					-	▲ 0.102	0.490	0.000	27,584.35	▲ 22.11	131.38-40	131.14-16
T/N			▲ 0.007					-	▲ 0.107						
S/N			▲ 0.015					-	-						
1W	▲ 0.038	0.008	▲ 0.028					-	▲ 0.116						
2W								-	▲ 0.126						
3W			▲ 0.001					-	▲ 0.138						
1M								-	▲ 0.147						
3M								▲ 0.177	▲ 0.147						
6M								▲ 0.150	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.082						
										日付	2/2	2/3	2/6	2/7	2/8
										日銀当預残	5,143,400	5,123,000	5,141,100	5,147,900	5,138,400
										準備預金残	4,472,400	4,454,900	4,473,800	4,475,100	4,476,700
										マネタリーベース	6,414,000	6,392,500	6,409,900	6,415,600	6,405,600
										無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.012%	▲0.021%	▲0.029%	▲0.035%
										コール市場残高	207,099	197,573	181,782	178,643	182,612
										うち無担	179,939	170,535	152,823	151,888	155,626
										うちO/N	113,518	103,544	87,361	85,976	88,479
										うち有担	27,160	27,038	28,959	26,755	26,986

## ●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1137	-	45,000	2023/2/10	2023/8/10	153,978.0	36,914.6	100.0570	▲0.1148%	21.4375%	100.0660	▲0.1330%	8,085.0
物債連動10年	27	0.005%	2,500	2023/2/10	2032/3/10	7,643.0	2,500.00	101.6500	▲0.1730%	72.0000%			

## ●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		2023/2/10		0.010	280	280				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/10		0.112	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/9	2023/2/10	▲0.350	55,130	55,130		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/9	2023/2/10	▲0.350	271	271		▲0.350	▲0.352	

\*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10日の予定

*1月の企業物価指数	*1月の米財政収支	*国庫短期証券(1138回)入札(3ヶ月、63,000億円、2/13発行)
	*2月のミンガン大消費者信頼感指数速報	
	*10-12月期の英GDP速報値	

◆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