

Central Daily Market Report

2023年2月10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10日 需給速報	2023年2月13日 需給予想	2023年2月14日 当社予想			
銀行券	200	900	▲ 1,000			
財政	▲ 3,600	5,500	▲ 2,000			
資金過不足	▲ 3,400	6,400	▲ 3,000			
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	300	200				
CP等買入		▲ 500	4,000	▲ 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	▲ 54,500	55,100	54,500			
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 3,000	65,000	▲ 3,000			
当座預金残高	5,152,300	5,217,300	5,214,300			
準備預金残高	4,489,200					
積み終了先	4,489,200		2月13日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,489,200		積数	0		
非準備預金先	663,100		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	100.00%	日数			90.32%

●2023年2月10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。週末要因が意識され取り上がる先も見られた一方、▲0.05%を下回る出合いも一定数見られた事で、全体的としては前日比で小幅な上昇に留まった。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~▲0.085%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>

10日はTB3M物(第1138回)の入札が実施され、事前予想に比べやや強め結果となった。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、一部の業態で大型発行が実施された。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

2023/2/10	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	▲ 0.034					-	▲ 0.101	0.490	0.000	27,670.98	86.63	131.52-54	130.44-46
T/N								-	▲ 0.106						
S/N			▲ 0.015					-	-						
1W	▲ 0.033	▲ 0.032	▲ 0.032					-	▲ 0.115						
2W								-	▲ 0.125						
3W								-	▲ 0.138						
1M								-	▲ 0.144						
3M								▲ 0.179	▲ 0.147						
6M								▲ 0.150	▲ 0.108						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.082						
日付		2/3	2/6	2/7	2/8	2/9									
日銀当預残	5,123,000	5,141,100	5,147,900	5,138,400	5,155,300										
準備預金残	4,454,900	4,473,800	4,475,100	4,476,700	4,488,700										
マネタリーベース	6,392,500	6,409,900	6,415,600	6,405,600	6,422,200										
無担O/N加重平均	▲0.012%	▲0.021%	▲0.029%	▲0.035%	▲0.036%										
コール市場残高	197,573	181,782	178,643	182,612	185,089										
うち無担	170,535	152,823	151,888	155,626	158,568										
うちO/N	103,544	87,361	85,976	88,479	90,671										
うち有担	27,038	28,959	26,755	26,986	26,521										

●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	素分率	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	1138	-	63,000	2023/2/13	2023/5/22	154,451.0	51,365.3	100.0415	▲0.1545%	0.5526%	100.0443	▲0.1649%	11,634.0

●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		2023/2/13		0.010	248	248				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/13		0.100	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/10	2023/2/13	▲0.350	54,538	54,538		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/10	2023/2/13	▲0.350	314	314		▲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13日の予定

*流動性供給入札
(5,000億円、2/14発行)

◆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