

Central Daily Market Report

2023年2月14日(火)

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14日 需給速報	2023年2月15日 需給予想	2023年2月16日 当社予想			
銀行券	400	▲ 400	▲ 500			
財政	800	72,400	▲ 2,000			
資金過不足	1,200	72,000	▲ 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			10,000			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 500		
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	▲ 53,300	52,700		53,300		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減		300		135,800		▲ 2,500
当座預金残高	5,165,200		5,301,000		5,298,500	
準備預金残高	4,548,900					
積み終了先	4,548,900			2月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,548,900			積数		0
非準備預金先	616,300			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		96.77%

●2023年2月14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▲0.035~▲0.025%近辺の調達で始まった。積み最終日を明日に控え、最終調整による調達からやや取り上がる先も見られたが、一巡後は散発的な出会いの中、▲0.065~▲0.03%程度まで低下した。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

また本日は、期間5年物(2023年2月15日~2028年2月15日)の共通担保資金供給オペ(全店・金利入札方式)が10,000億円でオファされた。結果は、応札額30,318億円に対し、落札額10,004億円、按分レート0.100%、平均落札レート0.121%、按分率19.0%となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.085%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>

14日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、無難な結果となった。マーケットで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、複数の業態で発行が見られた。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

2023/2/14	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	▲ 0.032					-	▲ 0.091	0.500	0.000	27,602.77	175.45	132.34-36	132.07-08
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.092						
S/N			▲ 0.010					-	-						
1W								-	▲ 0.110						
2W	▲ 0.030	▲ 0.002	▲ 0.024					-	▲ 0.117						
3W								-	▲ 0.128						
1M	▲ 0.013	0.100	0.025					-	▲ 0.139						
3M								▲ 0.179	▲ 0.146						
6M								▲ 0.150	▲ 0.105						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.081						
日付		2/7	2/8	2/9	2/10	2/13									
日銀当預残	5,147,900	5,138,400	5,155,300	5,152,300	5,164,900										
準備預金残	4,475,100	4,476,700	4,488,700	4,489,200	4,546,400										
マネタリーベース	6,415,600	6,405,600	6,422,200	6,418,900	6,430,700										
無担O/N加重平均	▲0.029%	▲0.035%	▲0.036%	▲0.034%	▲0.035%										
コール市場残高	178,643	182,612	185,089	185,395	179,743										
うち無担	151,888	155,626	158,568	158,627	150,813										
うちO/N	85,976	88,479	90,671	91,590	84,126										
うち有担	26,755	26,986	26,521	26,768	28,930										

●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・利回較差	棄分率	募入平均価格	募入平均利・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
国有林野借入	-	-	962	2023/2/27	2028/2/25	4,249.0	962.00	-	0.0500%	100.0000%	-	0.0500%	-

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/2/15			3,365	1,000		0.006	0.006	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/2/15		0.000	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		2023/2/15		0.100	0	0				
米ドル資金供給		2023/2/16	2023/2/24	4.830	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/14	2023/2/15	▲0.350	53,837	53,837		▲0.350	▲0.351	
共通担保資金供給(全店) <金利入札方式>	10,000	2023/2/15	2028/2/15		30,318	10,004	0.100		0.121	19.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/14	2023/2/15	▲0.350	0	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15日の予定

*12月の第3次産業活動指数	*1月の米小売売上高 *1月の米鉱工業生産・設備稼働率	*12月の米企業在庫 *1月の英消費者物価指数
----------------	--------------------------------	----------------------------

◆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