

Central Daily Market Report

2023年2月15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15日 需給速報	2023年2月16日 需給予想	2023年2月17日 当社予想			
銀行券	▲ 400	▲ 900	▲ 1,500			
財政	73,000	600	▲ 18,000			
資金過不足	72,600	▲ 300	▲ 19,500			
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		16,200				
CP等買入		▲ 500	▲ 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					300	▲ 1,300
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	▲ 52,400	53,300	52,400			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当増減	84,000	68,200	▲ 20,500			
当座預金残高	5,249,200	5,317,400	5,296,900			
準備預金残高	4,633,500					
積み終了先	4,633,500			2月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,633,500			積数	3,518,100	
非準備預金先	615,700			1日平均	125,600	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					3,518,100	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2023年2月15日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日となり、邦銀業態を中心に積極的な資金調達が行われた事で、レート水準は▲0.025~▲0.015%程度まで上昇する展開となった。一巡後は徐々にビッドが減少する中、▲0.065~▲0.025%程度で散発的な出合いが見られた。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、▲0.10~▲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>

15日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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実施され、大型発行も見られた。発行レートは概ね横這い圏であった。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

2023/2/15	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考計値	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.026				-	▲ 0.088	0.500	0.000	27,501.86	▲ 100.91	132.97-99	133.32-34
T/N							-	▲ 0.092						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.015	▲ 0.029				-	▲ 0.106						
2W	▲ 0.020	0.040	▲ 0.012				-	▲ 0.115						
3W			▲ 0.008				-	▲ 0.121						
1M	▲ 0.015	0.000	▲ 0.013				-	▲ 0.135						
3M			0.005				▲ 0.179	▲ 0.146						
6M							▲ 0.150	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.115	▲ 0.081						
日付	2/8	2/9	2/10	2/13	2/14									
日銀当預残	5,138,400	5,155,300	5,152,300	5,164,900	5,165,200									
準備預金残	4,476,700	4,488,700	4,489,200	4,546,400	4,548,900									
マネタリーベース	6,405,600	6,422,200	6,418,900	6,430,700	6,430,600									
無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.036%	▲0.034%	▲0.035%	▲0.032%									
コール市場残高	182,612	185,089	185,395	179,743	174,821									
うち無担	155,626	158,568	158,627	150,813	145,647									
うちO/N	88,479	90,671	91,590	84,126	79,010									
うち有担	26,986	26,521	26,768	28,930	29,174									

●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		2023/2/16		0.000	54	54				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/16		0.115	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/2/16			8,575	4,254	▲0.003		0.000	2.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/2/16			16,247	6,758	▲0.003		▲0.002	78.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/2/16			5,461	3,003	▲0.006		▲0.003	74.8
国債買入(残存期間25年超)	2,000	2023/2/16			2,523	2,001	▲0.017		0.003	2.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/15	2023/2/16	▲0.350	52,842	52,842		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/15	2023/2/16	▲0.350	0	0				
被災地金融支援オペ	第19回	2023/2/17	2025/2/17	0		346				

●2023年2月16日の予定

*1月の貿易統計	*1月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1139回) (1年、35,000億円、2/20発行)
*12月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比+3.0%)	*1月の米生産者物価指数	*5年利付国債入札 (25,000億円、2/17発行)
		*交付税特別会計借入 (12,000億円、2/28借入)

◆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