

Central Daily Market Report

2023年2月20日(月)
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20日 需給速報	2023年2月21日 需給予想	2023年2月22日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 400	▲ 1,000			
財政	▲ 18,600	300	2,000			
資金過不足	▲ 19,100	▲ 100	1,000			
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						▲ 2,800
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	400	18,000				
CP等買入		▲ 100	▲ 200			
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	1,000			
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						
国債補充供給	▲ 55,600	53,900	55,600			
※ドル資金供給用担保提供増額						
当増増減	▲ 20,800	74,300	▲ 1,800			
当座預金残高	5,223,600	5,297,900	5,296,100			
準備預金残高	4,573,800					
積み終了先	4,568,700			2月21日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,568,600			積数	24,200	
非準備預金先	649,800			1日平均	1,100	
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	99.31%	日数	17.86%		

●2023年2月20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▲0.01~▲0.005%近辺での出会いとなった。引き続き資金調達需要が強いものの、週末要因が剥落した事でレートは小幅に低下した。ターム物は、ショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.075%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>

本日のアウトライ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。発行レートは、概ね横這い圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/2/20	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	▲ 0.065	0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.081	0.500	0.000	27,531.94	18.81	134.30-32	134.04-06
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.083						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.008					-	▲ 0.109						
3W			▲ 0.010					-	▲ 0.121						
1M								-	▲ 0.134						
3M								▲ 0.150	▲ 0.146						
6M								▲ 0.145	▲ 0.105						
1Y								▲ 0.085	▲ 0.085						
日付	2/13	2/14	2/15	2/16	2/17										
日銀当預残	5,164,900	5,165,200	5,249,200	5,260,300	5,244,400										
準備預金残	4,546,400	4,548,900	4,633,500	4,597,100	4,576,100										
マネタリーベース	6,430,700	6,430,600	6,515,000	6,526,900	6,511,000										
無担O/N加重平均	▲0.035%	▲0.032%	▲0.026%	▲0.010%	▲0.007%										
コール市場残高	179,743	174,821	174,864	190,542	190,957										
うち無担	150,813	145,647	145,730	161,106	161,475										
うちO/N	84,126	79,010	80,298	93,504	82,872										
うち有担	28,930	29,174	29,134	29,436	29,482										

●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。

●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		2023/2/21		0.000	538	538				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/21		0.085	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	4,250	2023/2/21			8,349	4,257	0.002		0.002	69.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/2/21			15,384	5,006	▲0.002		▲0.001	31.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/2/21			16,148	6,764	▲0.002		▲0.001	94.9
国債買入(残存期間25年超)	1,500	2023/2/21			2,994	1,505	0.000		0.003	89.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/20	2023/2/21	▲0.350	56,020	56,020		▲0.350	▲0.353	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/20	2023/2/21	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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21日の予定

*月例経済報告	*1月の米中古住宅販売	*20年利付国債入札 (12,000億円、2/22発行) *交付税特別会計借入 (12,000億円、3/6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