

# Central Daily Market Report

2023年2月21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21日 需給速報	2023年2月22日 需給予想	2023年2月24日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 1,000	▲ 1,500			
財政	5,200	▲ 7,900	3,000			
資金過不足	4,700	▲ 8,900	1,500			
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			4,300	▲ 2,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	18,000		1,500			
CP等買入		▲ 200		▲ 600		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入	1,000			▲ 100		
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 55,700	55,600		55,700		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	23,400		50,100			1,500
当座預金残高	5,247,000		5,297,100			5,298,600
準備預金残高	4,594,800					
積み終了先	4,590,500			2月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,590,400			積数		19,800
非準備預金先	652,200			1日平均		900
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	99.44%	日数	21.43%		

## ●2023年2月21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く、レートは高水準で推移した。また、一部邦銀から試し取りによるプラス圏での出会いも見られた。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、▲0.08%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>

本日は短国買入オペが前回と同額の1000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。アウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物に少額の出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2023/2/21	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	▲ 0.009					-	▲ 0.080	0.500	0.000	27,473.10	▲ 58.84	134.33-36	134.57-59
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.082						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.010					-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.009					-	▲ 0.106						
3W			▲ 0.008					-	▲ 0.119						
1M	▲ 0.005	0.020	0.007					-	▲ 0.132						
3M								▲ 0.148	▲ 0.146						
6M								▲ 0.145	▲ 0.105						
1Y								▲ 0.089	▲ 0.083						
日付	2/14	2/15	2/16	2/17	2/20										
日銀当預残	5,165,200	5,249,200	5,260,300	5,244,400	5,223,600										
準備預金残	4,548,900	4,633,500	4,597,100	4,576,100	4,573,900										
マネタリーベース	6,430,600	6,515,000	6,526,900	6,511,000	6,490,600										
無担O/N加重平均	▲0.032%	▲0.026%	▲0.010%	▲0.007%	▲0.009%										
コール市場残高	174,821	174,864	190,542	190,957	192,982										
うち無担	145,647	145,730	161,106	161,475	164,640										
うちO/N	79,010	80,298	93,504	82,872	84,607										
うち有担	29,174	29,134	29,436	29,482	28,342										

## ●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I非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
20年利付国債	183	1.40%	12,000	2023/2/22	2042/12/20	29,962.0	9,829.0	101.3500	1.3140%	88.9563%	101.4800	1.3060%	2,162	10.00
交付税特会	-	-	12,000	2023/3/6	2023/9/4	402,199.0	11,990.16		0.0000%	2.9812%		0.0000%		

## ●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/2/22			4,772	1,000		0.012	0.012	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/2/22		0.000	1,495	1,495				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/22		0.085	0	0				
米ドル資金供給		2023/2/24	2023/3/2	4.830	3	3				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/21	2023/2/22	▲0.350	56,194	56,194		▲0.350	▲0.353	
共通担保資金供給(全店) <固定金利・金額無制限>		2023/2/22	2023/3/8	0.000	4,290	4,290				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/21	2023/2/22	▲0.350	33	33		▲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22日の予定

*群馬県金融経済懇談会において田村日銀審議委員講演	*1月の企業向けサービス価格指数
---------------------------	------------------

◆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り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