

Central Daily Market Report

2023年2月22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22日 需給速報	2023年2月24日 需給予想	2023年2月27日 当社予想			
銀行券	▲ 1,000	▲ 500	▲ 500			
財政	▲ 13,500	7,600	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 14,500	7,100	▲ 7,500			
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	1,500		5,500			
CP等買入		▲ 600		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 100		▲ 200		
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	53,300		54,500		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当増増減	▲ 12,400		66,500		▲ 7,500	
当座預金残高	5,234,600		5,301,100		5,293,600	
準備預金残高	4,575,100					
積み終了先	4,573,100			2月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,571,700			積数	12,900	
非準備預金先	659,500			1日平均	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	99.63%	日数			28.57%

●2023年2月22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なか、祝日前の2日積みとなった事が影響し、レート水準は前日比でやや上昇となったが、一巡後は若干低下し、▲0.03%近辺での出会いも一部見られた。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>

本日のアウトライイト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、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。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分落札レート0.003%、平均落札レート0.015%と、前回(按分落札レート0.003%、平均落札レート0.006%)比で、按分は横ばい、平均は上昇した。

●短期金融市場関連指標

2023/2/22	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			直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
単位：%							売買参考統計値	平均値	0.500	0.000	27,104.32	▲ 368.78	134.99-01	134.72-74
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.008				-	▲ 0.079						
T/N	▲ 0.010	▲ 0.007	▲ 0.009				-	▲ 0.082						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.021				-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.040	▲ 0.005	▲ 0.028				-	▲ 0.106						
3W			0.000				-	▲ 0.117						
1M	▲ 0.008	0.000	▲ 0.007				-	▲ 0.131						
3M							▲ 0.145	▲ 0.146						
6M							▲ 0.145	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.089	▲ 0.084						
日付		2/15	2/16	2/17	2/20	2/21								
日銀当預残		5,249,200	5,260,300	5,244,400	5,223,600	5,247,000								
準備預金残		4,633,500	4,597,100	4,576,100	4,573,900	4,594,800								
マネタリーベース		6,515,000	6,526,900	6,511,000	6,490,600	6,514,500								
無担O/N加重平均		▲0.026%	▲0.010%	▲0.007%	▲0.009%	▲0.009%								
コール市場残高		174,864	190,542	190,957	192,982	196,707								
うち無担		145,730	161,106	161,475	164,640	164,880								
うちO/N		80,298	93,504	82,872	84,607	84,177								
うち有担		29,134	29,436	29,482	28,342	31,827								

●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		2023/2/24		0.000	1,413	1,413				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/24		0.060	0	0				
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/2/24			10,001	3,004	0.004		0.007	27.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,000	2023/2/24			3,033	1,004	▲0.005		▲0.003	78.6
CP等買入	4,000	2023/2/28			6,530	3,980	0.003		0.015	0.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/22	2023/2/24	▲0.350	54,861	54,861		▲0.350	▲0.353	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/22	2023/2/24	▲0.350	183	183		▲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23日の予定

*天皇誕生日

*10-12月期の米GDP改定値

*1月のユーロ圏消費者物価指数改定値

●2023年2月24日の予定

*1月の全国消費者物価指数(CPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+4.2%)

*1月の米個人所得・消費支出
*1月の米新築一戸建て販売件数

*国庫短期証券(1141回)入札
(3ヶ月、63,000億円、2/27発行)
*流動性供給入札
(5,000億円、2/27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