

Central Daily Market Report

2023年2月24日(金)
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24日 需給速報	2023年2月27日 需給予想	2023年2月28日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 400	▲ 100			
財政	8,000	▲ 2,100	9,500			
資金過不足	7,500	▲ 2,500	9,400			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	5,500					
CP等買入		▲ 400	▲ 800	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 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						▲ 14,500
E T F買入						
国債補完供給	▲ 59,600	54,500	59,600			
※ドル資金供給用担保提供増減						
当預増減	7,300	56,300	▲ 1,100			
当座預金残高	5,241,900	5,298,200	5,297,100			
準備預金残高	4,586,900					
積み終了先	4,585,500			2月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,585,100			積数	7,300	
非準備預金先	655,000			1日平均	400	
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	99.79%	日数	39.29%		

●2023年2月24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。レート水準は週末3日積みとなったが、前営業日となる22日も祝日を前に2日積みであった事から、前営業日比では概ね横ばい圏での推移となった。
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、▲0.085~▲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TB3M物(1141回)の入札が実施され、事前予想通り無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、やや堅調に推移した。

<CP市場>

CP市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。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

2023/2/24	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	▲ 0.060	0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.081	0.500	0.000	27,453.48	349.16	134.62-63	134.83-85
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.084						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W			▲ 0.010					-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.015	▲ 0.007	▲ 0.014					-	▲ 0.106						
3W								-	▲ 0.116						
1M	▲ 0.006	0.180	0.002					-	▲ 0.132						
3M								▲ 0.150	▲ 0.145						
6M								▲ 0.145	▲ 0.105						
1Y								▲ 0.089	▲ 0.084						
日付	2/16	2/17	2/20	2/21	2/22										
日銀当預残	5,260,300	5,244,400	5,223,600	5,247,000	5,234,600										
準備預金残	4,597,100	4,576,100	4,573,900	4,594,800	4,573,700										
マネタリーベース	6,526,900	6,511,000	6,490,600	6,514,500	6,503,100										
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.007%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.008%										
コール市場残高	190,542	190,957	192,982	196,707	193,158										
うち無担	161,106	161,475	164,640	164,880	164,112										
うちO/N	93,504	82,872	84,607	84,177	84,579										
うち有担	29,436	29,482	28,342	31,827	29,046										

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1141	-	63,000	2023/2/27	2023/6/5	183,364.0	51,251.3	100.0350	▲0.1303%	58.8551%	100.0381	▲0.1418%	11,748.0
流動性供給	376		5,000	2023/2/27		17,161.0	4,983.00		▲0.0170%	49.4514%		▲0.0190%	

●オペ結果

種類	オフター額(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		2023/2/27		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		2023/2/27		0.050	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オフター分)		2023/2/24	2023/2/27	▲0.350	60,227	60,227		▲0.350	▲0.354	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2023/2/24	2023/2/27	▲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ター。※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ター。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特別第39期(借り換え)	2023/3/3	2024/3/4	1,022	11
成長基盤強化	米ドル特別第35期(借り換え)	2023/3/3	2024/3/4	1,093	10
成長基盤強化	米ドル特別第31期(借り換え)	2023/3/3	2024/3/4	38	11

●2023年2月27日の予定

*12月の景気動向指数改訂状況	*1月の米耐久財新規受注
-----------------	--------------

◆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