

Central Daily Market Report

2023年2月28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28日 需給速報	2023年3月1日 需給予想	2023年3月2日 当社予想			
銀行券	▲ 400	▲ 200	▲ 1,500			
財政	9,200	▲ 31,200	▲ 55,000			
資金過不足	8,800	▲ 31,400	▲ 56,500			
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	16,000					
CP等買入	4,000	▲ 3,100				
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		▲ 100		
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	5,400	▲ 14,500				
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 61,800	54,500		67,100		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当預増減	9,000	46,600		▲ 56,500		
当座預金残高	5,248,800	5,295,400		5,238,900		
準備預金残高	4,587,700					
積み終了先	4,586,500			3月1日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,586,300			積数	2,900	
非準備預金先	661,100			1日平均	200	
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	99.92%		日数	46.43%	

●2023年2月28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~▲0.007%近辺での出会いが始まった。引き続き資金調達ニーズは強く、レートは高止まりで推移した。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

また本日は、4本目となる期間5年物(2023年3月1日~2028年3月1日)の共通担保資金供給オペ(全店・金利入札方式)が10,000億円でおfferされた。結果は、応札額30,245億円に対し、落札額10,010億円、按分レート0.110%、平均落札レート0.133%、按分比率3.8%となった。

<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>

28日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でおfferされ、無難な結果となった。マーケットでは3M物と1Y物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2023/2/28	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.011					-	▲ 0.087	0.500	0.000	27,445.56	21.60	136.32-34	136.75-76
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.087						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.096						
2W	▲ 0.025	0.001	▲ 0.017					-	▲ 0.106						
3W			0.100					-	▲ 0.115						
1M	▲ 0.008	0.005	▲ 0.005					-	▲ 0.141						
3M								▲ 0.180	▲ 0.145						
6M								▲ 0.145	▲ 0.107						
1Y								▲ 0.089	▲ 0.083						
日付		2/20	2/21	2/22	2/24	2/27									
日銀当預残		5,223,600	5,247,000	5,234,600	5,241,900	5,239,800									
準備預金残		4,573,900	4,594,800	4,573,700	4,587,600	4,599,900									
マネタリーベース		6,490,600	6,514,500	6,503,100	6,510,800	6,509,100									
無担O/N加重平均		▲ 0.009%	▲ 0.009%	▲ 0.008%	▲ 0.009%	▲ 0.010%									
コール市場残高		192,982	196,707	193,158	191,129	189,486									
うち無担		164,640	164,880	164,112	162,299	160,383									
うちO/N		84,607	84,177	84,579	83,531	85,795									
うち有担		28,342	31,827	29,046	28,830	29,103									

●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)
2年利付国債	446	0.005%	29,000	2023/3/1	2025/3/1	95,958.0	23,338.0	100.0600	▲0.0240%	93.1818%	100.0650	▲0.0270%	5,655.0

●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	2023/3/1			4,546	1,000		0.004	0.006	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/3/1		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		2023/3/1		0.061	0	0				
米ドル資金供給		2023/3/2	2023/3/9	4.830	2	2				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/2/28	2023/3/1	▲1.100	24,383	23,751		▲1.100	▲3.828	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/28	2023/3/1	▲0.350	38,628	38,628		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)・金利入札方式	10,000	2023/3/1	2028/3/1		30,245	10,010	0.110		0.133	3.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/28	2023/3/1	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2023/3/1	2023/3/10		2	2		▲0.100	▲0.100	

*オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)の場合は、上債期間利回り、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。
※3国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)の売却銘柄は、利付国債(10年)第367回(落札額13,000億円、応札額13,632億円)、368回(落札額10,751億円、応札額10,751億円)です。

●2023年3月1日の予定

*福島県金融経済懇談会において 中川日銀審議委員講演	*2月の米CB消費者信頼感指数 *2月のISM 製造業景況指数 *1月の米建設支出	*交付税特別会計借入 (11,450億円、3/10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