

Central Daily Market Report

2023年2月7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7日 需給速報	2023年2月8日 需給予想	2023年2月9日 当社予想			
銀行券	1,100	500	500			
財政	600	▲ 7,600	3,000			
資金過不足	1,700	▲ 7,100	3,500			
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			2,800	▲ 5,800		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入			100			
CP等買入		▲ 200		▲ 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						
新型コロナウイルス感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 53,500	58,800		53,500		
※ドル資金供給用担保国債供給						
当増増減	6,800		44,400			3,500
当座預金残高	5,147,900		5,192,300			5,195,800
準備預金残高	4,474,800					
積み終了先	4,474,700			2月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,474,300			積数		400
非準備預金先	673,100			1日平均		100
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額						3,906,000
準備預金進捗率		実績	99.99%	日数		74.19%

●2023年2月7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▲0.04~▲0.02%近辺の調達で始まった。前日に続きレートが低下基調となるなか、一巡後は▲0.05~▲0.04%近辺で散発的な出合いが見られた。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、▲0.105~▲0.10%程度での出合いとなった。SCI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>

7日のアウトライト市場は、動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、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

2023/2/7	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	▲ 0.029					-	▲ 0.101	0.490	0.000	27,685.47	▲ 8.18	132.60-62	132.15-17
T/N			▲ 0.006					-	▲ 0.107						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W			0.001					-	▲ 0.116						
2W	▲ 0.040	0.000	▲ 0.031					-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.137						
1M								-	▲ 0.144						
3M								▲ 0.177	▲ 0.146						
6M								▲ 0.115	▲ 0.107						
1Y								▲ 0.115	▲ 0.081						
日付		1/31	2/1	2/2	2/3	2/6									
日銀当預残	5,247,600	5,225,400	5,143,400	5,123,000	5,141,100										
準備預金残	4,584,300	4,549,400	4,472,400	4,454,900	4,473,800										
マネタリーベース	6,519,000	6,496,100	6,414,000	6,392,500	6,409,900										
無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.013%	▲ 0.013%	▲ 0.012%	▲ 0.021%										
コール市場残高	190,647	202,258	207,099	197,573	181,782										
うち無担	165,187	174,928	179,939	170,535	152,823										
うちO/N	102,386	109,727	113,518	103,544	87,361										
うち有担	25,460	27,330	27,160	27,038	28,959										

●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)
30年利付国債	77	1.60%	9,000	2023/2/8	2052/12/20	24,216.0	7,287.0	101.0000	1.5510%	96.9964%	101.1500	1.5430%	1,709.0
エネルギー対策	-	-	6,400	2023/2/20	2024/2/20	164,169.0	6,399.76		0.0000%	3.8984%		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	2023/2/8			3,341	1,000	0.012		0.014	8.0
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/2/8		0.010	70	70				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/8		0.125	0	0				
米ドル資金供給		2023/2/9	2023/2/16	4.830	2	2				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/7	2023/2/8	▲ 0.350	53,739	53,739		▲ 0.350	▲ 0.351	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/2/8	2023/2/22	0.000	2,771	2,771				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/7	2023/2/8	▲ 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	2023/2/8	2023/2/17		2	2		▲ 0.100	▲ 0.100	

*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。

※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8日の予定

*12月の国際収支	*12月の米卸売売上高
*1月の景気ウォッチャー調査	
◆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	