

Central Daily Market Report

2023年2月16日(木)

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16日 需給速報	2023年2月17日 需給予想	2023年2月20日 当社予想			
銀行券	▲ 900	0	▲ 500			
財政	900	▲ 16,700	▲ 15,000			
資金過不足	0	▲ 16,700	▲ 15,500			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	16,200	300				
CP等買入		▲ 100	▲ 300			
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	▲ 1,300		
				▲ 100		
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	▲ 55,300	50,300	55,300			
当預増減	11,100	37,500	▲ 15,500			
当座預金残高	5,260,300	5,297,800	5,282,300			
準備預金残高	4,597,000					
積み終了先	3,433,800			2月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,395,100			積数	316,200	
非準備預金先	663,300			1日平均	11,700	
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	91.01%	日数	3.57%		

●2023年2月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新積み期間に入り、基準比率が大幅に上昇した事を背景に、積極的な資金調達が行われた。レート水準は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.01~▲0.007%近辺での出会いとなった。一巡後は僅かに低下したものの、散発的な出会いが見られた程度となった。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、▲0.095~▲0.085%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>

16日はTB1Y物(第1139回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、同程度の水準で推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、大型発行を含め多くの業態で発行が実施された。発行レートは概ね横這い圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/2/16	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.065	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.087	0.500	0.000	27,696.44	194.58	133.90-92	133.77-79
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.087						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.025				-	▲ 0.103						
2W	▲ 0.025	▲ 0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.122						
1M	▲ 0.015	▲ 0.007	▲ 0.010				-	▲ 0.135						
3M								▲ 0.179						
6M								▲ 0.145						
1Y								▲ 0.095						
日付		2/9	2/10	2/13	2/14	2/15								
日銀当預残	5,155,300	5,152,300	5,164,900	5,165,200	5,249,200									
準備預金残	4,488,700	4,489,200	4,546,400	4,548,900	4,633,500									
マネタリーベース	6,422,200	6,418,900	6,430,700	6,430,600	6,515,000									
無担O/N加重平均	▲0.036%	▲0.034%	▲0.035%	▲0.032%	▲0.026%									
コール市場残高	185,089	185,395	179,743	174,821	174,864									
うち無担	158,568	158,627	150,813	145,647	145,730									
うちO/N	90,671	91,590	84,126	79,010	80,298									
うち有担	26,521	26,768	28,930	29,174	29,134									

●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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1139	-	35,000	2023/2/20	2024/2/20	108,681.0	28,476.8	100.0860	▲0.0859%	33.7376%	100.0960	▲0.0959%	6,523	
5年利付国債	156	0.200%	25,000	2023/2/17	2027/12/20	80,843.0	20,329.0	99.9200	0.2160%	87.9205%	99.9200	0.2160%	4,662	
交付税特会	-	-	12,000	2023/2/28	2023/8/31	447,400.0	11,990.30		0.0000%	2.6800%		0.0000%		10.00

●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		2023/2/17		0.000	300	300				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/17		0.111	0	0				
社債等買入	1,000	2023/2/21			1,608	1,000	0.195		0.235	37.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/16	2023/2/17	▲0.350	55,753	55,753		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/16	2023/2/17	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(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17日の予定

*12月の石油等消費動態統計	*国庫短期証券(1140回)入札 (3ヶ月、63,000億円、2/20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	