

# Central Daily Market Report

2023年2月17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17日 需給速報	2023年2月20日 需給予想	2023年2月21日 当社予想			
銀行券	0	▲ 500	▲ 500			
財政	▲ 16,200	▲ 17,700	4,000			
資金過不足	▲ 16,200	▲ 18,200	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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	300		400			
CP等買入		▲ 300		▲ 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	▲ 1,300				
		▲ 100		▲ 300	1,000	
新型コロナウイルス対応金融支援特別 氣候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 53,900	55,300		53,900		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 15,900		35,700			4,500
当座預金残高	5,244,400		5,280,100			5,284,600
準備預金残高	4,576,100					
積み終了先	4,570,600				2月20日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,480,800				積数	29,500
非準備預金先	668,300				1日平均	1,200
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	99.16%	日数	14.29%		

## ●2023年2月17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▲0.008~▲0.003%近辺での出会いとなった。引き続き資金調達需要が強い中、週末要因も加わった事で、前日に比べ一段と上昇する展開となった。  
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~▲0.075%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>

17日はTB3M物(第1140回)の入札が実施され、テールが流れる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、やや軟調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で発行が実施され、一部で大型発行も見られた。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

2023/2/17	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	▲ 0.007				-	▲ 0.083	0.500	0.000	27,513.13	▲ 183.31	134.06-08	134.79-81
T/N	▲ 0.040	▲ 0.010	▲ 0.012				-	▲ 0.083						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.005	▲ 0.007				-	▲ 0.101						
2W	▲ 0.009	▲ 0.007	▲ 0.008				-	▲ 0.111						
3W							-	▲ 0.119						
1M			▲ 0.008				-	▲ 0.135						
3M							▲ 0.150	▲ 0.147						
6M							▲ 0.145	▲ 0.104						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.084						
日付		2/10	2/13	2/14	2/15	2/16								
日銀当預残	5,152,300	5,164,900	5,165,200	5,249,200	5,260,300									
準備預金残	4,489,200	4,546,400	4,548,900	4,633,500	4,597,100									
マネタリーベース	6,418,900	6,430,700	6,430,600	6,515,000	6,526,900									
無担O/N加重平均	▲0.034%	▲0.035%	▲0.032%	▲0.026%	▲0.010%									
コール市場残高	185,395	179,743	174,821	174,864	190,542									
うち無担	158,627	150,813	145,647	145,730	161,106									
うちO/N	91,590	84,126	79,010	80,298	93,504									
うち有担	26,768	28,930	29,174	29,134	29,436									

## ●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	1140	-	63,000	2023/2/20	2023/5/29	165,291.0	51,251.40	100.0365	▲0.1358%	58.4803%	100.0410	▲0.1526%	11,748.0

## ●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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/2/20		0.000	428	428				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/20		0.095	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/17	2023/2/20	▲0.350	54,459	54,459		▲0.350	▲0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/17	2023/2/20	▲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20日の予定

\*New York祝日(Presidents' Day)

◆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