

# Central Daily Market Report

2023年2月27日(月)

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27日 需給速報	2023年2月28日 需給予想	2023年3月1日 当社予想			
銀行券	▲ 300	▲ 400	▲ 500			
財政	▲ 800	9,200	▲ 24,000			
資金過不足	▲ 1,100	8,800	▲ 24,500			
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		16,000				
CP等買入	▲ 800	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			
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	▲ 59,800	59,600	59,800			
当預増減	▲ 2,100	76,100	▲ 24,500			
当座預金残高	5,239,800	5,315,900	5,291,400			
準備預金残高	4,598,900					
積み終了先	4,597,500			2月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,595,800			積数	4,200	
非準備預金先	640,900			1日平均	300	
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	99.88%	日数	42.86%		

## ●2023年2月27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~▲0.006%近辺での出合いが始まった。引き続き資金調達ニーズは強いものの、週末要因が剥落した事から、レート目線を若干引き下げる先も見られた。一巡後はビッドが減少するなか、▲0.03%近辺で散発的な出合いが見られた程度で本日の取引を終えた。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%程度での出合いとなった。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>

27日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は複数の業態で発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏で推移した。

## ●入札結果

本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。

## ●短期金融市場関連指標

2023/2/27	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.059	0.001	▲ 0.010				-	▲ 0.087
T/N	▲ 0.010	▲ 0.008	▲ 0.010				-	▲ 0.087
S/N			▲ 0.005				-	-
1W	▲ 0.040	▲ 0.015	▲ 0.022				-	▲ 0.098
2W			▲ 0.005				-	▲ 0.105
3W							-	▲ 0.117
1M	0.003	0.005	0.005				-	▲ 0.135
3M							▲ 0.170	▲ 0.143
6M							▲ 0.145	▲ 0.107
1Y							▲ 0.089	▲ 0.083

JGB新発10年債	日経平均株価		ドル/円		
	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
0.500	0.000	27,423.96	▲ 29.52	136.42-44	136.17-19
日付	2/17	2/20	2/21	2/22	2/24
日銀当預残	5,244,400	5,223,600	5,247,000	5,234,600	5,241,900
準備預金残	4,576,100	4,573,900	4,594,800	4,573,700	4,587,600
マネタリーベース	6,511,000	6,490,600	6,514,500	6,503,100	6,510,800
無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.009%	▲0.009%	▲0.008%	▲0.009%
コール市場残高	190,957	192,982	196,707	193,158	191,129
うち無担	161,475	164,640	164,880	164,112	162,299
うちO/N	82,872	84,607	84,177	84,579	83,531
うち有担	29,482	28,342	31,827	29,046	28,830

## ●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		2023/2/28		0.000	174	174				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/28		0.076	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/2/28			12,303	5,003	0.002		0.003	66.9
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/2/28			12,476	6,755	▲0.001		0.002	73.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/2/28			5,921	3,006	▲0.006		▲0.002	6.2
国債買入(物価連動債)	600	2023/2/28			1,924	601	▲0.160		▲0.391	9.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※3		2023/2/27	2023/2/28	▲1.100	25,400	25,400		▲1.100	▲1.380	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/2/27	2023/2/28	▲0.350	34,880	34,880		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/27	2023/2/28	▲1.100	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/2/27	2023/2/28	▲0.350	80	80		▲0.350	▲0.350	

\*オペの種類が、国債補完供給(国債売現先)の場合は、上取期間利回り。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(13,826億円)、368回(11,574億円)です。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)	
新型コロナ対応金融支援特別	プロパー融資分	2023/2/28	2023/5/26	0	5,355

(参考) 2023/2/28時点の貸出残高 (億円)	
制度融資分	29,170
プロパー融資分	60,077
合計	89,247

## ●2023年2月28日の予定

- \*1月の商業動態統計速報
- \*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報  
(市場予想:前月比▲2.6%)
- \*1月の住宅着工統計

- \*12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
- \*2月のシカゴPM景況感指数

- \*2年利付国債入札  
(29,000億円、3/1発行)

◆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の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