

# Central Daily Market Report

2023年1月4日(水)

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1月4日 需給速報	2023年1月5日 需給予想	2023年1月6日 当社予想			
銀行券	2,500	2,800	4,000			
財政	▲ 22,500	▲ 5,300	▲ 56,000			
資金過不足	▲ 20,000	▲ 2,500	▲ 52,000			
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						
国債買入	10,000		6,100			
CP等買入						
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対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 33,100	35,600		33,100		
※ドル資金供給用担保債提供額						
当増減	▲ 7,500		46,700		▲ 52,000	
当座預金残高	5,017,400		5,064,100		5,012,100	
準備預金残高	4,374,800					
積み終了先	4,374,700				1月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,374,700				積数	700
非準備預金先	642,600				1日平均	100
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						3,904,800
準備預金進捗率	実績	99.98%		日数	64.52%	

## ●2023年1月4日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.06~▲0.03%程度の調達で始まった。年末年始による5日積み要因が剥落した事に加え、大手行が調達を控えた事も影響し、レート水準は前営業日比で低下となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

12月29日に発表された2年物(2023年1月5日~2025年1月6日)の共通担保資金供給オペ(全店・固定金利0.0%)が10,000億円でおファーされた。結果は、応札額58,267億円、落札額10,016億円(按分率17.2%)となった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.09%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>

4日のアウトラ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、一部の業態で大型発行が実施された。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

2023/1/4	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.038					-	▲ 0.091	0.455	0.045	25,716.86	▲ 377.64	131.29-30	130.24-26
T/N								-	▲ 0.096						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.030	▲ 0.034					-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.070	0.180	▲ 0.040					-	▲ 0.114						
3W								-	▲ 0.118						
1M	▲ 0.060	0.150	▲ 0.028					-	▲ 0.124						
3M								▲ 0.140	▲ 0.135						
6M								▲ 0.128	▲ 0.120						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.100						
日付		12/26	12/27	12/28	12/29	12/30									
日銀当預残		5,021,900	5,036,300	5,035,300	5,025,800	5,024,900									
準備預金残		4,375,300	4,409,300	4,408,800	4,418,000	4,425,700									
マネタリーベース		6,314,700	6,331,600	6,333,100	6,325,700	6,324,100									
無担O/N加重平均		▲ 0.062%	▲ 0.053%	▲ 0.047%	▲ 0.033%	▲ 0.022%									
コール市場残高		176,254	181,309	182,191	181,377	137,335									
うち無担		146,660	154,403	153,163	153,422	112,220									
うちO/N		72,950	80,973	80,383	83,171	72,972									
うち有担		29,594	26,906	29,028	27,955	25,115									

## ●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。

## ●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		2023/1/5		0.075	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		2023/1/5		0.045	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間1年超3年以下)※3		2023/1/5		0.000	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間3年超5年以下)※4		2023/1/5		0.000	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	2,000	2023/1/5			7,265	2,003	▲0.005		▲0.004	52.1
国債買入(残存期間3年超5年以下)	1,000	2023/1/5			3,433	1,000	▲0.025		▲0.018	12.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	1,500	2023/1/5			6,142	1,504	0.011		0.012	90.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2023/1/5			5,244	1,504	0.002		0.005	3.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/4	2023/1/5	▲0.350	33,490	33,490		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利方式＞	10,000	2023/1/5	2025/1/6		58,267	10,016				17.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/4	2023/1/5	▲0.350	117	117		▲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367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固定利回較差の結果、2年利付国債444回の買入利回りは、0.030%となる。買入金額に制限を設けずオファー。※4固定利回較差の結果、5年利付国債154回の買入利回りは、0.230%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

## ●2023年1月5日の予定

\*12月のマネタリーベース \*12月の消費動向調査 \*11月の米貿易収支 \*国庫短期証券(1129回)入札(3ヶ月、60,000億円、1/6発行)  
\*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み \*10年利付国債入札(27,000億円、1/6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いますが、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り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