

Central Daily Market Report

2023年1月5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1月5日 需給速報	2023年1月6日 需給予想	2023年1月10日 当社予想			
銀行券	2,900	3,100	3,000			
財政	5,900	▲ 62,400	▲ 17,500			
資金過不足	8,800	▲ 59,300	▲ 14,500			
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	10,000		20,000			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	6,100					
CP等買入			▲ 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対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 31,000	33,100		31,000		
※ドル資金供給用担保債提供						
当預増減	27,000		▲ 8,400		▲ 14,500	
当座預金残高	5,044,400		5,036,000		5,021,500	
準備預金残高	4,394,200					
積み終了先	4,394,100			1月6日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,394,100			積数	600	
非準備預金先	650,200			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	67.74%		

●2023年1月5日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.045~▲0.03%の調達で始まった。一巡後も同水準の出合いが継続し、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。また本日も、2年物(2023年1月6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20,000億円でオファーされた。結果は、応札額51,717億円、落札額20,014億円(按分率38.7%)となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.085%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>

5日は3M物(1129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マーケットではやや堅調な展開となった。その他、6M物や1Y物のカレント銘柄には特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートに目立った変化は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2023/1/5	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	▲ 0.039					-	▲ 0.093	0.500	0.045	25,820.80	103.94	132.23-26	132.48-49
T/N								-	▲ 0.095						
S/N								-	-						
1W				▲ 0.060				-	▲ 0.104						
2W	▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.045					-	▲ 0.112						
3W								-	▲ 0.117						
1M	▲ 0.040	0.030	▲ 0.028					-	▲ 0.124						
3M								▲ 0.120	▲ 0.129						
6M								▲ 0.128	▲ 0.114						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.099						
										日付	12/27	12/28	12/29	12/30	1/4
										日銀当預残	5,036,300	5,035,300	5,025,800	5,024,900	5,017,400
										準備預金残	4,409,300	4,408,800	4,418,000	4,425,700	4,375,300
										マネタリーベース	6,331,600	6,333,100	6,325,700	6,324,100	6,314,100
										無担O/N加重平均	▲ 0.053%	▲ 0.047%	▲ 0.033%	▲ 0.022%	▲ 0.038%
										コール市場残高	181,309	182,191	181,377	137,335	159,725
										うち無担	154,403	153,163	153,422	112,220	131,091
										うちO/N	80,973	80,383	83,171	72,972	76,414
										うち有担	26,906	29,028	27,955	25,115	28,634

●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非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1129	-	60,000	2023/1/6	2023/4/4	143,222.0	48,729.60	100.0250	▲0.1036%	97.1798%	100.0291	▲0.1206%	11,270	
10年利付国債	369	0.500%	27,000	2023/1/6	2032/12/20	104,518.0	21,938.0	100.0000	0.5000%	28.1152%	100.0000	0.5000%	5,049	3.15

●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)	按分率・利回較差・価格較差	全取率・利回較差・価格較差	平均落札率・利回較差・価格較差	按分率
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/1/6		0.030	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		2023/1/6		0.026	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/5	2023/1/6	▲0.350	31,477	31,477		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2023/1/6	2025/1/6		51,717	20,014				38.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/5	2023/1/6	▲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366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1月6日の予定

*1月の日銀当座預金増減要因見込み	*12月の米雇用統計	*国庫短期証券(1130回)入札(6ヶ月、45,000億円、1/10発行)
*11月の毎月勤労統計調査速報	*11月の米製造業新規受注・出荷・在庫	
	*12月のISM 非製造業景況指数	
	*12月のユーロ圏消費者物価指数速報値	

◆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