

# Central Daily Market Report

2023年1月6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1月6日 需給速報	2023年1月10日 需給予想	2023年1月11日 当社予想			
銀行券	3,200	2,700	3,000			
財政	▲ 66,200	▲ 24,800	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 63,000	▲ 22,100	▲ 2,000			
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	20,000	20,000				▲ 4,700
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		24,100				
CP等買入		▲ 100		▲ 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						
新型コロナ対応金融支援特別 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 25,700	31,000		25,700		
※ドル資金供給用担保債供給						
当預増減	▲ 37,800	47,600		▲ 6,700		
当座預金残高	5,006,600	5,054,200		5,047,500		
準備預金残高	4,385,800					
積み終了先	4,385,700		1月10日以降の残り所要積立額			200
超過準備	4,385,700		積数			0
非準備預金先	620,800		1日平均			0
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	99.99%	日数			80.65%

## ●2023年1月6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▲0.03~▲0.005%の調達で始まった。週末4日積みとなるなか、大手行を中心に取り上がる展開となった事で、前日に比べレート水準は上昇となった。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10日~2025年1月10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40,721億円、落札額20,011億円(按分率49.1%)となった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.09%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>

6日は6M物(1130回)の入札が実施され、按分落札利回りと平均落札利回りが離れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、出合いは見られなかったものの、入札水準と比較して強めの買い気配が見られた。その他、3M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、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。

## ●2023年1月9日の予定

\*成人の日 \*11月の米消費者信用残高

## ●2023年1月10日の予定

\*11月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比+0.5%)  
\*12月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+3.8%)  
\*11月の米卸売売上高  
\*国庫短期証券(1131回)入札(3ヶ月、60,000億円、1/11発行)

## ●短期金融市場関連指標

2023/1/6	無担(速報)			有担(速報)			短期 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	
	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)	為替(17時)
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.091	0.500	0.000	25,973.85	153.05	133.32-34	134.24-26
T/N							-	▲ 0.095						
S/N							-	-						
1W							-	▲ 0.103						
2W							-	▲ 0.111						
3W			0.040				-	▲ 0.114						
1M			0.480				-	▲ 0.123						
3M							▲ 0.120	▲ 0.127						
6M							▲ 0.115	▲ 0.108						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.098						
日付	12/28	12/29	12/30	1/4	1/5									
日銀当預残	5,035,300	5,025,800	5,024,900	5,017,400	5,044,400									
準備預金残	4,408,800	4,418,000	4,425,700	4,375,300	4,394,200									
マネタリーベース	6,333,100	6,325,700	6,324,100	6,314,100	6,338,200									
無担O/N加重平均	▲ 0.047%	▲ 0.033%	▲ 0.022%	▲ 0.038%	▲ 0.039%									
コール市場残高	182,191	181,377	137,335	159,725	168,453									
うち無担	153,163	153,422	112,220	131,091	139,789									
うちO/N	80,383	83,171	72,972	76,414	81,598									
うち有担	29,028	27,955	25,115	28,634	28,664									

## ●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	1130	-	45,000	2023/1/10	2023/7/10	149,061.0	36,977.90	100.0340	▲0.0685%	2.3376%	100.0500	▲0.1007%	8,022.0

## ●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		2023/1/10		0.000	5,937	5,937				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/10		0.040	0	0				
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2023/1/10			7,490	1,500	0.020		0.032	50.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2023/1/10			11,028	5,002	▲0.005		0.000	48.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,750	2023/1/10			7,816	5,753	▲0.023		▲0.013	2.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/1/10			15,716	3,005	0.000		0.002	29.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/1/10			7,088	3,002	▲0.014		▲0.010	31.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/6	2023/1/10	▲0.350	26,037	26,037		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2023/1/10	2025/1/10		40,721	20,011				49.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/6	2023/1/10	▲0.350	30	30		▲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。

◆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