

Central Daily Market Report

2023年1月10日(火)

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10日 需給速報	2023年1月11日 需給予想	2023年1月12日 当社予想			
銀行券	2,800	2,700	2,500			
財政	▲ 20,800	48,000	▲ 78,000			
資金過不足	▲ 18,000	50,700	▲ 75,500			
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	20,000		1,400	▲ 4,700		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	24,100		2,600			
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	▲ 36,700	25,700		36,700		
※下ル資金供給用担保提供給						
当預増減	15,000		86,700		▲ 75,500	
当座預金残高	5,021,600		5,108,300		5,032,800	
準備預金残高	4,391,100					
積み終了先	4,391,000					
超過準備	4,391,000					
非準備預金先	630,500					
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						3,901,400
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	83.87%		

●2023年1月10日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落した事から、レート水準は前営業日に比べやや低下する展開となった。立ち上がりは、邦銀業態からの調達を中心に▲0.05~▲0.02%近辺での出会いとなった。一巡後は、レート水準がやや低下し、▲0.07~▲0.04%近辺で散発的な出会いが見られた程度で、取引を終了した。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見されたが、積み期間の切り替わりを控え、慎重姿勢の参加者も多く動意に乏しい展開となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.095%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>

本日の短国市場は、3M物の入札が延期となる中、特段の出会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、一部で大型発行も見られた。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

2023/1/10 単位：%	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	発表参考統計値	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	▲ 0.027				-	▲ 0.092	0.500	0.000	26,175.56	201.71	131.72-74	132.22-23
T/N							-	▲ 0.100						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.035	▲ 0.023	▲ 0.029				-	▲ 0.107						
2W	▲ 0.055	▲ 0.025	▲ 0.046				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.119						
1M							-	▲ 0.126						
3M	0.001	0.030	0.014				▲ 0.120	▲ 0.127						
6M							▲ 0.115	▲ 0.110						
1Y							▲ 0.065	▲ 0.099						
日付	12/29	12/30	1/4	1/5	1/6									
日銀当預残	5,025,800	5,024,900	5,017,400	5,044,400	5,006,600									
準備預金残	4,418,000	4,425,700	4,375,300	4,394,200	4,386,600									
マネタリーベース	6,325,700	6,324,100	6,314,100	6,338,200	6,297,200									
無担O/N加重平均	▲ 0.033%	▲ 0.022%	▲ 0.038%	▲ 0.039%	▲ 0.015%									
コール市場残高	181,377	137,335	159,725	168,453	191,025									
うち無担	153,422	112,220	131,091	139,789	159,517									
うちO/N	83,171	72,972	76,414	81,598	99,396									
うち有担	27,955	25,115	28,634	28,664	31,508									

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
1月10日(火)に実施を予定しておりました国庫短期証券(第1131回)の入札につきましては、日銀ネットが一部利用できない状況にあったことから、延期されました。													

●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)	発札総額(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	平均発札レート・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		2023/1/11		0.000	2,628	2,628				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/11		0.055	0	0				
米ドル資金供給		2023/1/12	2023/1/19	4.580	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/10	2023/1/11	▲ 0.350	37,110	37,110		▲ 0.350	▲ 0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/1/11	2023/1/25		1,359	1,359				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/10	2023/1/11	▲ 0.350	60	60		▲ 0.350	▲ 0.350	

*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1月11日の予定

*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *11月の景気動向指数速報	*国庫短期証券(1131回)(3ヶ月、60,000億円、1/12発行) *30年利付国債入札(9,000億円、1/12発行) *交付税特別会計借入(13,000億円、1/19借入)
--	--

◆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