

Central Daily Market Report

2023年1月11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11日 需給速報	2023年1月12日 需給予想	2023年1月13日 当社予想			
銀行券	2,800	2,000	2,000			
財政	43,500	▲ 76,000	▲ 1,000			
資金過不足	46,300	▲ 74,000	1,000			
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	1,400	▲ 4,700				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	2,600	12,100				
CP等買入			▲ 300			
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感染症 気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 34,500	36,500	34,700			
当増増減	47,600	▲ 27,500	1,000			
当座預金残高	5,069,200	5,041,700	5,042,700			
準備預金残高	4,430,500					
積み終了先	4,430,500			1月12日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,430,500			積数	100	
非準備預金先	638,700			1日平均	0	
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	100.00%	日数	87.10%		

●2023年1月11日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、前日に比べレート水準が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。一巡後はビッドサイドが閑散気味となり、▲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、16日以降の新積み期スタートの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、▲0.105~▲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>

11日はTB3M物(第1131回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移する展開となった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で大型発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏であった。CP等買入オペが、事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.002%、平均レート0.010%と 前回(按分0.002%、平均0.012%)比で、按分は横ばい、平均は若干低下となった。

●2023年1月12日の予定

- *日銀支店長会議 さくらレポート(地域経済報告)
- *11月の国際収支
- *12月の景気ウォッチャー調査
- *12月の米消費者物価指数
- *12月の米財政収支

●短期金融市場関連指標

2023/1/11	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		▲ 0.087	0.001	▲ 0.030				-	▲ 0.097	0.500	0.000	26,446.00	270.44	132.09-11	132.41-43
T/N								-	▲ 0.103						
S/N								-	-						
1W		▲ 0.060	▲ 0.003	▲ 0.032				-	▲ 0.109						
2W		▲ 0.050	▲ 0.040	▲ 0.049				-	▲ 0.116						
3W								-	▲ 0.122						
1M								-	▲ 0.127						
3M								▲ 0.120	▲ 0.127						
6M								▲ 0.115	▲ 0.109						
1Y								▲ 0.065	▲ 0.097						
日付										12/30	1/4	1/5	1/6	1/10	
日銀当預残										5,024,900	5,017,400	5,044,400	5,006,600	5,021,600	
準備預金残										4,425,700	4,375,300	4,394,200	4,386,600	4,392,200	
マネタリーベース										6,324,100	6,314,100	6,338,200	6,297,200	6,309,400	
無担O/N加重平均										▲ 0.022%	▲ 0.038%	▲ 0.039%	▲ 0.015%	▲ 0.027%	
コール市場残高										137,335	159,725	168,453	191,025	178,398	
うち無担										112,220	131,091	139,789	159,517	148,772	
うちO/N										72,972	76,414	81,598	99,396	88,801	
うち有担										25,115	28,634	28,664	31,508	29,626	

●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	乗分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非備格募入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1131	-	60,000	2023/1/12	2023/4/10	143,148.0	48,729.5	100.0255	▲0.1057%	52.6588%	100.0282	▲0.1169%	11,270	
30年利付国債	77	1.600%	9,000	2023/1/12	2052/12/20	22,719.0	7,318.0	98.9000	1.6540%	38.0180%	99.0000	1.6490%	1,676	
交付税特会	-	-	13,000	2023/1/19	2023/7/18	385,889.0	12,990.25		0.0000%	3.3674%	0.0000			10.00

●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		2023/1/12		0.000	4,680	4,680				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/12		0.030	0	0				
CP等買入	4,000	2023/1/16			8,750	3,990	0.002		0.010	7.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/11	2023/1/12	▲0.350	35,019	35,019		▲0.350	▲0.350	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間1年超3年以下)※3		2023/1/12		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		2023/1/12		0.005	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	1,000	2023/1/12			2,880	1,001	0.000		0.001	86.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	1,000	2023/1/12			2,512	1,001	▲0.004		0.002	10.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,000	2023/1/12			16,897	3,010	▲0.001		0.002	1.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2023/1/12			4,521	2,002	▲0.014		▲0.009	50.5
国債買入(残存期間25年超)	500	2023/1/12			1,501	502	▲0.024		▲0.016	7.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/11	2023/1/12	▲0.350	87	87		▲0.350	▲0.350	

*オペの種類は、国債補充供給(国債売現先)の場合は、上乗期間利回り、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399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、0.025%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。

◆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