

Central Daily Market Report

2023年1月12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12日 需給速報	2023年1月13日 需給予想	2023年1月16日 当社予想			
銀行券	2,100	2,100	2,500			
財政	▲ 71,400	3,000	▲ 19,000			
資金過不足	▲ 69,300	5,100	▲ 16,500			
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			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	12,100		45,500			
CP等買入		▲ 300		▲ 400	4,000	
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	▲ 37,900	34,700		37,900		
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	▲ 60,700		109,100		▲ 12,500	
当座預金残高	5,008,500		5,117,600		5,105,100	
準備預金残高	4,376,300					
積み終了先	4,376,200			1月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,376,200			積数	100	
非準備預金先	632,200			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	90.32%	

●2023年1月12日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、積み最終日を明日に控え、積極的な資金調達ニーズが見られた事で、レート水準は上昇となった。立ち上がりは、邦銀業態からの調達を中心に▲0.03~▲0.015%近辺での出会いとなった。一巡後は▲0.06~▲0.03%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、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~▲0.10%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>

12日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱め結果となった。マーケットでは1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の業態で発行が実施され、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

2023/1/12	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	▲ 0.022					-	▲ 0.094	0.500	0.000	26,449.82	3.82	131.89-92	131.60-61
T/N			▲ 0.015					-	▲ 0.102						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W			▲ 0.060					-	▲ 0.109						
2W	▲ 0.055	▲ 0.001	▲ 0.037					-	▲ 0.114						
3W			▲ 0.045					-	▲ 0.122						
1M	▲ 0.045	0.180	▲ 0.020					-	▲ 0.127						
3M								▲ 0.130	▲ 0.128						
6M								▲ 0.115	▲ 0.109						
1Y								▲ 0.020	▲ 0.093						
日付		1/4	1/5	1/6	1/10	1/11									
日銀当預残		5,017,400	5,044,400	5,006,600	5,021,600	5,069,200									
準備預金残		4,375,300	4,394,200	4,386,600	4,392,200	4,428,100									
マネタリーベース		6,314,100	6,338,200	6,297,200	6,309,400	6,354,200									
無担O/N加重平均		▲ 0.038%	▲ 0.039%	▲ 0.015%	▲ 0.027%	▲ 0.030%									
コール市場残高		159,725	168,453	191,025	178,398	173,624									
うち無担		131,091	139,789	159,517	148,772	144,190									
うちO/N		76,414	81,598	99,396	88,801	85,399									
うち有担		28,634	28,664	31,508	29,626	29,434									

●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
国庫短期証券買入	1,000	2023/1/13			7,532	1,000	0.041		0.044	49.5
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/1/13		0.000	25,084	25,084				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/13		0.025	3,000	3,000				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2023/1/13			10,578	5,004	0.008		0.010	54.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	7,750	2023/1/13			29,103	7,752	0.018		0.022	28.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/1/13			5,698	3,002	0.014		0.017	96.5
国債買入(残存期間25年超)	2,000	2023/1/13			3,991	2,002	▲0.009		▲0.004	89.6
国債買入(変動利付債)	300	2023/1/13			401	300	▲2.700		▲2.742	98.8
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/12	2023/1/13	▲0.350	38,418	38,418		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	20,000	2023/1/13	2025/1/14		37,006	20,008				54.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/12	2023/1/13	▲0.350	135	135		▲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。

●2023年1月13日の予定

*12月のマネーストック	*国庫短期証券(1132回)入札(3ヶ月、60,000億円、1/16発行)
*11月の特定サービス産業動態統計速報	*5年利付国債入札(25,000億円、1/16発行)
*1月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*エネルギー対策債入(6,400億円、1/20借入)

◆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