

Central Daily Market Report

2023年1月16日(月)
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16日 需給速報	2023年1月17日 需給予想	2023年1月18日 当社予想			
銀行券	1,800	1,700	1,500			
財政	▲ 24,900	8,200	▲ 6,000			
資金過不足	▲ 23,100	9,900	▲ 4,500			
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						
国債買入	49,400		21,200			
CP等買入	4,000	▲ 500	▲ 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	▲ 78,100	50,900	78,100			
※ドル資金供給用担保提供開始						
当預増減	22,600	109,100	▲ 4,500			
当座預金残高	5,084,700	5,193,800	5,189,300			
準備預金残高	4,442,900					
積み終了先	2,747,400			1月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,142,700			積数	610,000	
非準備預金先	641,800			1日平均	20,300	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					3,910,200	
準備預金進捗率	実績	84.40%	日数	3.23%		

●2023年1月16日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新しい積み期間に入り、基準比率が上昇した事による要因からか、ビッドサイドの調達ニーズが強まり、邦銀業態からの調達を中心に▲0.035~▲0.02%程度での出会いとなった。ターム物は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。SCI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>

16日のアウトライ市場は動意なく閑散な中、特段の出会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、概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2023/1/16	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.026					-	▲ 0.096	0.500	0.000	25,822.32	▲ 297.20	128.05-08	127.97-00
T/N								-	▲ 0.112						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.008	▲ 0.026					-	▲ 0.119						
2W	▲ 0.032	0.000	▲ 0.021					-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.129						
1M	▲ 0.020	0.000	▲ 0.017					-	▲ 0.139						
3M								▲ 0.190	▲ 0.132						
6M								▲ 0.115	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.020	▲ 0.087						
日付	1/6	1/10	1/11	1/12	1/13										
日銀当預残	5,006,600	5,021,600	5,069,200	5,008,500	5,062,100										
準備預金残	4,386,600	4,392,200	4,428,100	4,376,300	4,409,800										
マネタリーベース	6,297,200	6,309,400	6,354,200	6,291,500	6,342,900										
無担O/N加重平均	▲ 0.015%	▲ 0.027%	▲ 0.030%	▲ 0.022%	▲ 0.035%										
コール市場残高	191,025	178,398	173,624	178,612	179,305										
うち無担	159,517	148,772	144,190	148,085	149,945										
うちO/N	99,396	88,801	85,399	89,144	91,454										
うち有担	31,508	29,626	29,434	30,527	29,360										

●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
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/1/17		0.000	2,149	2,149				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/17		0.000	4,996	4,996				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間1年超3年以下)※3		2023/1/17		0.000	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	1,000	2023/1/17			2,706	1,000	0.000		0.004	4.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/1/17			11,485	5,002	▲0.028		▲0.023	42.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,000	2023/1/17			11,448	5,000	▲0.041		▲0.028	59.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/1/17			5,488	3,001	▲0.037		▲0.026	80.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/16	2023/1/17	▲0.350	75,330	75,330		▲0.350	▲0.563	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/16	2023/1/17	▲0.350	4,199	4,199		▲0.350	▲0.543	

*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。※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、0.030%となる。買入金額に制限を設けずオファー。

●2023年1月17日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目)	*流動性供給入札 (5,000億円、1/18発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、1/25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り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		