

Central Daily Market Report

2023年1月17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17日 需給速報	2023年1月18日 需給予想	2023年1月19日 当社予想			
銀行券	1,700	1,100	2,000			
財政	8,700	▲1,400	▲3,000			
資金過不足	10,400	▲300	▲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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入			1,000			
国債買入	21,200		8,800			
CP等買入		▲100		▲400		
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	▲85,000	78,100		85,000		
※ドル資金供給用担保提供増額						
当預増減	24,600		94,100		▲1,000	
当座預金残高	5,109,300		5,203,400		5,202,400	
準備預金残高	4,473,200					
積み終了先	4,365,800			1月18日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,961,200			積数	98,000	
非準備預金先	636,100			1日平均	3,400	
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	97.49%	日数	6.45%		

●2023年1月17日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態からの調達を中心に▲0.02~▲0.01%の出会いで始まった。調達ニーズは非常に強いものの、一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。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、▲0.135~▲0.105%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>

17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、弱めの結果となった。マーケットで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発行市場は複数の発行が観測され、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

2023/1/17	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	▲0.070	0.001	▲0.014					-	▲0.095	0.500	0.000	26,138.68	316.36	128.33-35	128.71-73
T/N								-	▲0.117						
S/N			▲0.005					-	-						
1W			▲0.020					-	▲0.126						
2W	▲0.030	▲0.013	▲0.022					-	▲0.136						
3W								-	▲0.137						
1M			▲0.010					-	▲0.143						
3M	0.010	0.025	0.019					▲0.190	▲0.133						
6M								▲0.115	▲0.106						
1Y								▲0.020	▲0.086						
										日付	1/10	1/11	1/12	1/13	1/16
										日銀当預残	5,021,600	5,069,200	5,008,500	5,062,100	5,084,700
										準備預金残	4,392,200	4,428,100	4,376,300	4,409,800	4,442,900
										マネタリーベース	6,309,400	6,354,200	6,291,500	6,342,900	6,363,700
										無担O/N加重平均	▲0.027%	▲0.030%	▲0.022%	▲0.035%	▲0.026%
										コール市場残高	178,398	173,624	178,612	179,305	188,620
										うち無担	148,772	144,190	148,085	149,945	159,346
										うちO/N	88,801	85,399	89,144	91,454	98,524
										うち有担	29,626	29,434	30,527	29,360	29,274

●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I非償 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億円)
流動性供給	373	-	5,000	2023/1/18	-	23,349.0	4,998.00	-	0.0010%	20.3101%	-	▲0.0020%	-	-
交付税特会	-	-	13,000	2023/1/25	2023/7/25	356,684.0	12,990.19	-	0.0000%	3.6466%	-	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
国庫短期証券買入	1,000	2023/1/18			3,236	1,000			0.052	0.052
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/1/18		0.000	4,288	4,288				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/18		0.000	4,677	4,677				
米ドル資金供給		2023/1/19	2023/1/26	4.580	3	3				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/17	2023/1/18	▲0.350	83,593	83,593		▲0.350	▲0.435	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/17	2023/1/18	▲0.350	3,044	3,044		▲0.350	▲0.662	

*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18日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)	*12月の米小売売上高	*12月の米生産者物価指数
*黒田日銀総裁、定例会見	*12月の米鉱工業生産・設備稼働率	*11月の米企業在庫
*経済・物価情勢の展望	*米ベージュブック	*12月のユーロ圏消費者物価指数改定値
*11月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲0.9%)	*12月の英消費者物価指数	

◆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