

Central Daily Market Report

2023年1月18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18日 需給速報	2023年1月19日 需給予想	2023年1月20日 当社予想			
銀行券	1,200	400	1,000			
財政	1,300	4,300	▲ 24,000			
資金過不足	2,500	4,700	▲ 23,000			
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			1,200			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入	8,800		700			
CP等買入		▲ 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						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 82,800	85,000	82,800			
※ドル資金供給用担保準備増減						
当預増減	14,100	89,400	▲ 23,000			

●2023年1月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀からの調達を中心に▲0.01%近辺の出合いで始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出合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。また、本で行われた金融政策決定会合では、全員一致で現状維持となった。加えて、金融調節の円滑化を図る観点から共通担保資金供給オペの拡充が決定された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.14~▲0.095%程度での出合いとなった。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>

18日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●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。

●2023年1月19日の予定

- *12月の貿易統計 *11月の石油等消費動態統計 *12月の米住宅着工件数
- *国庫短期証券(1133回)入札(1年、35,000億円、1/20発行)
- *20年利付国債入札(12,000億円、1/20発行)
- *交付税特別会計借入(13,000億円、1/30借入)

当座預金残高	5,123,400	5,212,800	5,189,800	
準備預金残高	4,478,300			
積み終了先	4,456,000	1月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,433,800	積数	53,600	
非準備預金先	645,100	1日平均	1,900	
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	98.63%	日数	9.68%

●短期金融市場関連指標

2023/1/18	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	前日比	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.070	0.001	▲ 0.011					-	▲ 0.098	0.415	▲ 0.085	26,791.12	652.44	128.27-29	130.24-27
T/N								-	▲ 0.122						
S/N				▲ 0.005				-	-						
1W	▲ 0.023	▲ 0.005	▲ 0.014					-	▲ 0.129						
2W	▲ 0.027	▲ 0.003	▲ 0.017					-	▲ 0.137						
3W								-	▲ 0.141						
1M								-	▲ 0.143						
3M								▲ 0.190	▲ 0.136						
6M								▲ 0.115	▲ 0.103						
1Y								▲ 0.020	▲ 0.081						
日付		1/11	1/12	1/13	1/16	1/17									
日銀当預残		5,069,200	5,008,500	5,062,100	5,084,700	5,109,300									
準備預金残		4,428,100	4,376,300	4,409,800	4,442,900	4,473,100									
マネタリーベース		6,354,200	6,291,500	6,342,900	6,363,700	6,386,600									
無担O/N加重平均		▲ 0.030%	▲ 0.022%	▲ 0.035%	▲ 0.026%	▲ 0.014%									
コール市場残高		173,624	178,612	179,305	188,620	200,258									
うち無担		144,190	148,085	149,945	159,346	169,974									
うちO/N		85,399	89,144	91,454	98,524	107,583									
うち有担		29,434	30,527	29,360	29,274	30,284									

●オペ結果

種類	オフター (億円・ 百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付 利率*	店札総額 (億円・ 百万ドル)	発札総額 (億円・ 百万ドル)	採分レート ・利回総差 ・借付総差	全取レート ・利回総差 ・借付総差	平均採分レート ・利回総差 ・借付総差	採分 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		2023/1/19		0.000	320	320				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/19		▲0.005	380	380				
国債補充供給(国債売現先・即日(午前オフター分))		2023/1/18	2023/1/19	▲0.350	83,984	83,984		▲0.350	▲0.411	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/1/19		0.000	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※4		2023/1/19		▲0.005	0	0				
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	10,000	2023/1/19	2025/1/20		1,163	1,163				
国債補充供給(国債売現先・即日(午後オフター分))		2023/1/18	2023/1/19	▲0.350	330	330		▲0.350	▲0.350	

●日銀政策決定会合・結果

- 当面の金融政策運営について
- 1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。
 - (1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)(全員一致)
 - ① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする。
 - 短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。
 - 長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。
 - ② 長短金利操作の運用
 - 長期金利の変動幅を「±0.5%程度」とし、10年物国債金利について0.5%の利回りで指値オペを、明らかに応札が見込まれない場合を除き、毎営業日、実施する。上記の金融市場調節方針と整合的なイールドカーブの形成を促すため、大規模な国債買入れを継続するとともに、各年限において、機動的に、買入れ額の増額や指値オペを実施する。
 - (2) 資産買入れ方針(全員一致)
 - 長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。
 - ① E T FおよびJ-R E I Tについて、それぞれ年間約1.2兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。
 - ② C P等、社債等については、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(C P等: 約2兆円、社債等: 約3兆円)へと徐々に戻していく。ただし、社債等の買入れ残高の調整は、社債の発行環境に十分配慮して進めることとする。
- 2. 日本銀行は、①「貸出増加を支援するための資金供給」の貸付実行期限を1年間延長すること、②「気候変動対応オペ」の対象先を拡大し、新たに、系統会員金融機関を含めること、③「共通担保資金供給オペ」を拡充すること、を決定した(いずれも全員一致)。

◆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