

Central Daily Market Report

2023年1月19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19日 需給速報	2023年1月20日 需給予想	2023年1月23日 当社予想			
銀行券	500	1,000	▲ 500			
財政	2,300	▲ 24,700	▲ 5,000			
資金過不足	2,800	▲ 23,700	▲ 5,500			
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	1,200					
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	700					
CP等買入			▲ 600			
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	▲ 84,300	82,800	84,300			
※ドル資金供給用担保提供特約						
当預増減	3,200	60,000	▲ 5,500			
当座預金残高	5,126,600	5,186,600	5,181,100			
準備預金残高	4,469,100					
積み終了先	4,459,900			1月20日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,454,000			積数	38,500	
非準備預金先	657,500			1日平均	1,400	
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	99.02%	日数	12.90%		

●2023年1月19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▲0.01~▲0.005%での出合となった。調達ニーズが非常に強く、レート水準は、前日に比べやや上昇する展開となった。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、▲0.13~▲0.09%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>

19日はTB1Y物(第1133回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

<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

2023/1/19	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	▲0.010					-	▲0.096	0.405	▲0.010	26,405.23	▲385.89	128.53-55	128.17-19
T/N								-	▲0.111						
S/N				▲0.005				-	-						
1W	▲0.020	0.008	▲0.014					-	▲0.124						
2W	▲0.030	▲0.003	▲0.016					-	▲0.134						
3W								-	▲0.139						
1M	▲0.020	0.020	0.002					-	▲0.142						
3M	0.025	0.480	0.066					▲0.190	▲0.139						
6M								▲0.115	▲0.103						
1Y								▲0.070	▲0.081						
日付		1/12	1/13	1/16	1/17	1/18									
日銀当預残		5,008,500	5,062,100	5,084,700	5,109,300	5,123,400									
準備預金残		4,376,300	4,409,800	4,442,900	4,473,100	4,478,400									
マネタリーベース		6,291,500	6,342,900	6,363,700	6,386,600	6,399,500									
無担O/N加重平均		▲0.022%	▲0.035%	▲0.026%	▲0.014%	▲0.011%									
コール市場残高		178,612	179,305	188,620	200,258	203,097									
うち無担		148,085	149,945	159,346	169,974	175,278									
うちO/N		89,144	91,454	98,524	107,583	111,237									
うち有担		30,527	29,360	29,274	30,284	27,819									

●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1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1133	-	35,000	2023/1/20	2024/1/22	124,970.0	28,429.6	100.0320	▲0.0318%	50.5907%	100.0620	▲0.0616%	6,570	
20年利付国債	183	1.400%	12,000	2023/1/20	2042/12/20	32,609.0	9,691.0	100.9000	1.3420%	92.3846%	100.9200	1.3410%	2,299	
交付税特会	-	-	13,000	2023/1/30	2023/7/31	410,330.0	12,990.03		0.0000%	3.1658%		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		2023/1/20		0.085	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/1/20		0.095	0	0				
社債等買入	1,000	2023/1/24			1,840	1,000	0.252		0.280	44.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/19	2023/1/20	▲0.350	84,595	84,595		▲0.350	▲0.395	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/19	2023/1/20	▲0.350	607	607		▲0.350	▲0.350	

*オペの種類が、国債補充供給(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20日の予定

*12月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想：前年同月比(除く生鮮)+4.0%)	*12月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1134回)入札 (3ヶ月、60,000億円、1/23発行)
--	--------------	---

◆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