

Central Daily Market Report

2023年1月20日(金)

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20日 需給速報	2023年1月23日 需給予想	2023年1月24日 当社予想
銀行券	1,000	1,000	▲ 500
財政	▲ 26,100	4,300	▲ 3,000
資金過不足	▲ 25,100	5,300	▲ 3,500
金融調節			
	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通			
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入		18,600	
CP等買入	▲ 600		▲ 200
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入			▲ 200
1,000			
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	▲ 79,700	84,300	79,700
*ドル資金供給用担保提供開始			
当増減	▲ 21,100	103,200	▲ 2,500
当座預金残高	5,105,500	5,208,700	5,206,200
準備預金残高	4,454,300		
積み終了先	4,450,300	1月23日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,449,300	積数 23,500	
非準備預金先	651,200	1日平均 1,000	
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 99.40%	日数	22.58%

●2023年1月20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%近辺での出会いとなった。週末3日積みとなったが、前日に比べ大きな変化は無く、一巡後は散發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、▲0.11~▲0.09%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>

20日はTB3M物(第1134回)の入札が実施され、事前の予想通り無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調な推移となった。

<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

2023/1/20	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	東京 レポレート 平均値	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	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				-	▲ 0.095	0.400	▲ 0.005	26,553.53	148.30	128.36-38	128.87-90	
T/N							-	▲ 0.102							
S/N			▲ 0.005				-	-							
1W			▲ 0.020				-	▲ 0.122							
2W	▲ 0.020	0.100	0.008				-	▲ 0.134							
3W							-	▲ 0.138							
1M	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.011				-	▲ 0.142							
3M							▲ 0.175	▲ 0.140							
6M							▲ 0.115	▲ 0.106							
1Y							▲ 0.070	▲ 0.081							
									日付		1/13	1/16	1/17	1/18	1/19
									日銀当預残		5,062,100	5,084,700	5,109,300	5,123,400	5,126,600
									準備預金残		4,409,800	4,442,900	4,473,100	4,478,400	4,469,100
									マネタリーベース		6,342,900	6,363,700	6,386,600	6,399,500	6,402,200
									無担O/N加重平均		▲ 0.035%	▲ 0.026%	▲ 0.014%	▲ 0.011%	▲ 0.010%
									コール市場残高		179,305	188,620	200,258	203,097	209,218
									うち無担		149,945	159,346	169,974	175,278	179,564
									うちO/N		91,454	98,524	107,583	111,237	119,978
									うち有担		29,360	29,274	30,284	27,819	29,654

●入札結果

名称	回数	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募総額(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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1134	-	60,000	2023/1/23	2023/4/24	132,540.0	48,729.6	100.0360	▲0.1443%	35.1758%	100.0397	▲0.1591%	11,270.0

●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		2023/1/23		0.095	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		2023/1/23		0.135	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2023/1/23			7,170	5,003	▲0.007		▲0.005	86.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,750	2023/1/23			10,871	5,753	▲0.019		▲0.013	21.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/1/23			12,895	5,754	▲0.044		▲0.033	69.4
国債買入(残存期間25年超)	2,000	2023/1/23			3,739	2,009	▲0.007		▲0.003	59.4
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/20	2023/1/23	▲0.350	80,280	80,280		▲0.350	▲0.376	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/20	2023/1/23	▲0.350	19	19		▲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23日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(12月19・20日分)

◆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