

# Central Daily Market Report

2023年1月23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23日 需給速報	2023年1月24日 需給予想	2023年1月25日 当社予想			
銀行券	900	800	1,000			
財政	7,700	▲ 2,500	26,000			
資金過不足	8,600	▲ 1,700	27,000			
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			10,000			▲ 1,400
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		▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 79,400	79,700		79,400		
※ドル資金供給用担保債提供						
当預増減		27,100	88,700			25,600
当座預金残高	5,132,600		5,221,300			5,246,900
準備預金残高	4,470,200					
積み終了先	4,466,500			1月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,466,400			積数		19,700
非準備預金先	662,400			1日平均		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	99.50%		日数		25.81%

## ●2023年1月23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▲0.015~▲0.008%近辺での出会いとなった。前営業日に比べ、ビッド水準を引き下げる動きも散見されたが、全般的には、引き続き高い水準での出会いが中心となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

また本日は、期間5年物(2023年1月24日~2028年1月24日)の共通担保資金供給オペ(全店・金利入札方式)が10,000億円でおファーされた。結果は、応札額31,290億円に対し、落札額10,003億円、按分レート0.110%、平均落札レート0.145%、按分比率18.6%となった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲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>

23日のアウトライト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、複数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

2023/1/23	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	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	▲ 0.012				-	▲ 0.095	0.375	▲ 0.025	26,906.04	352.51	129.38-40	130.12-14
T/N							-	▲ 0.098						
S/N			▲ 0.005				-	-						
1W			▲ 0.015				-	▲ 0.120						
2W	▲ 0.025	▲ 0.020	▲ 0.023				-	▲ 0.130						
3W			▲ 0.003				-	▲ 0.140						
1M			0.160				-	▲ 0.144						
3M							▲ 0.175	▲ 0.142						
6M							▲ 0.115	▲ 0.105						
1Y							▲ 0.077	▲ 0.083						
日付	1/16	1/17	1/18	1/19	1/20									
日銀当預残	5,084,700	5,109,300	5,123,400	5,126,600	5,105,500									
準備預金残	4,442,900	4,473,100	4,478,400	4,469,100	4,452,600									
マネタリーベース	6,363,700	6,386,600	6,399,500	6,402,200	6,380,100									
無担O/N加重平均	▲ 0.026%	▲ 0.014%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.010%									
コール市場残高	188,620	200,258	203,097	209,218	211,305									
うち無担	159,346	169,974	175,278	179,564	180,860									
うちO/N	98,524	107,583	111,237	119,978	116,484									
うち有担	29,274	30,284	27,819	29,654	30,445									

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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		2023/1/24		0.100	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		2023/1/24		0.176	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/23	2023/1/24	▲ 0.350	78,142	78,142		▲ 0.350	▲ 0.364	
共通担保資金供給(全店) <金利入札方式>	10,000	2023/1/24	2028/1/24		31,290	10,003	0.110		0.145	18.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/23	2023/1/24	▲ 0.350	1,625	1,625		▲ 0.350	▲ 0.352	

\*オへの種類が、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24日の予定

*流動性供給入札 (5,000億円、1/25発行)	*交付税特別会計借入 (12,000億円、2/2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