

# Central Daily Market Report

2023年1月24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24日 需給速報	2023年1月25日 需給予想	2023年1月26日 当社予想			
銀行券	900	400	▲ 1,000			
財政	▲ 4,000	29,500	20,000			
資金過不足	▲ 3,100	29,900	19,000			
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	5,800	▲ 1,400			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証券買入		1,000				
国債買入						
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	1,000		▲ 400			
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	▲ 80,300	79,400	80,300			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	7,000	114,600	19,000			
当座預金残高	5,139,600	5,254,200	5,273,200			
準備預金残高	4,479,200					
積み終了先	4,477,400			1月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,476,000			積数	16,600	
非準備預金先	660,400			1日平均	800	
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	99.58%	日数	29.03%		

## ●2023年1月24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~▲0.01%近辺での出会いとなった。全体的にビッド水準を引き下げる動きが見られた事で、前日に比べやや低下した水準での取引が中心となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <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>

24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、やや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、少額の発行が中心となり、落ち着いたマーケットとなった。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

2023/1/24	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	▲ 0.073	0.001	▲ 0.015					-	▲ 0.094	0.405	0.030	27,299.19	393.15	130.57-59	129.85-87
T/N								-	▲ 0.096						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W			▲ 0.025					-	▲ 0.118						
2W								-	▲ 0.131						
3W								-	▲ 0.140						
1M			0.000					-	▲ 0.145						
3M								▲ 0.175	▲ 0.143						
6M								▲ 0.115	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.077	▲ 0.083						
										日付	1/17	1/18	1/19	1/20	1/23
										日銀当預残	5,109,300	5,123,400	5,126,600	5,105,500	5,132,600
										準備預金残	4,473,100	4,478,400	4,469,100	4,452,600	4,470,200
										マネタリーベース	6,386,600	6,399,500	6,402,200	6,380,100	6,406,300
										無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.012%
										コール市場残高	200,258	203,097	209,218	211,305	202,686
										うち無担	169,974	175,278	179,564	180,860	173,686
										うちO/N	107,583	111,237	119,978	116,484	108,410
										うち有担	30,284	27,819	29,654	30,445	29,000

## ●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)	非償格入札(億円)
流動性供給	374	-	5,000	2023/1/25	-	20,719.0	4,993.00	-	▲ 0.0010%	36.7681%	-	▲ 0.0040%	-	-
交付税特会	-	-	12,000	2023/2/2	2023/8/4	417,596.0	11,990.17	-	0.0000%	2.8713%	-	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	2023/1/25			5,056	1,000		0.016	0.016	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/1/25		0.125	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		2023/1/25		0.230	0	0				
米ドル資金供給		2023/1/26	2023/2/2	4.580	1	1				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/24	2023/1/25	▲ 0.350	79,789	79,789		▲ 0.350	▲ 0.360	
共通担保資金供給(全店) <固定金利・金額無制限>		2023/1/25	2023/2/8	0.000	5,770	5,770				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/24	2023/1/25	▲ 0.350	425	425		▲ 0.350	▲ 0.360	

\*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25日の予定

*11月の景気動向指数改訂状況	*月例経済報告
◆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	