

# Central Daily Market Report

2023年1月26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26日 需給速報	2023年1月27日 需給予想	2023年1月30日 当社予想			
銀行券	▲ 400	500	1,400			
財政	17,900	▲ 4,100	7,000			
資金過不足	17,500	▲ 3,600	8,400			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	19,400					
CP等買入		▲ 200	▲ 500	4,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入		▲ 400				
新型コロナ対応金融支援特別 氣候変動対応オペ			2,500	▲ 8,100		
E T F買入						▲ 20,500
国債補充供給	▲ 77,100	74,200	77,100			
※ドル資金供給用担保債提供給						
当増増減	33,400	67,400	▲ 8,100			
当座預金残高	5,212,100	5,279,500	5,271,400			
準備預金残高	4,546,200					
積み終了先	4,544,500			1月27日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,544,400			積数	13,000	
非準備預金先	665,900			1日平均	700	
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	99.67%	日数	35.48%		

## ●2023年1月26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%近辺での出会いで始まった。前日比で概ね横這い圏での推移となったが、一巡後は、レート水準がやや低下し、▲0.02%台での出会いも散見された。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>

26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

2023/1/26	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	▲ 0.014					-	▲ 0.092	0.460	0.025	27,362.75	▲ 32.26	129.24-26	129.47-49		
T/N								-	▲ 0.097								
S/N			▲ 0.005					-	-								
1W			0.008					-	▲ 0.113								
2W	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.002					-	▲ 0.124								
3W								-	▲ 0.138								
1M			▲ 0.020					-	▲ 0.143								
3M								▲ 0.175	▲ 0.143								
6M								▲ 0.115	▲ 0.106								
1Y								▲ 0.077	▲ 0.081								
												日付	1/19	1/20	1/23	1/24	1/25
												日銀当預残	5,126,600	5,105,500	5,132,600	5,139,600	5,178,700
												準備預金残	4,469,100	4,452,600	4,470,200	4,478,100	4,516,100
												マネタリーベース	6,402,200	6,380,100	6,406,300	6,412,400	6,451,100
												無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.012%	▲ 0.015%	▲ 0.014%
												コール市場残高	209,218	211,305	202,686	203,913	199,873
												うち無担	179,564	180,860	173,686	174,865	171,009
												うちO/N	119,978	116,484	108,410	106,169	101,563
												うち有担	29,654	30,445	29,000	29,048	28,864

## ●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非価格 競争入札(億円)
40年利付国債	15	1.000%	7,000	2023/1/27	2062/3/20	17,876.0	6,998.00	81.9500	1.6250%	5.0549%			

## ●オペ結果

種類	オフー額 (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		2023/1/27		0.065	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		2023/1/27		0.187	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オフー分)		2023/1/26	2023/1/27	▲0.350	77,315	77,315		▲0.350	▲0.360	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オフー分)		2023/1/26	2023/1/27	▲0.350	7	7		▲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ー。

種類	スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)
新型コロナ対応金融支援特別 プロパー融資分	2023/1/27	2023/4/27	0	2,514

(参考) 2023/1/27時点の貸出残高 (億円)	
制度融資分	37,717
プロパー融資分	60,676
合計	98,393

## ●2023年1月27日の予定

*1月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想: 前年同月比(除く生鮮)+4.2%)	*12月の米個人所得・消費支出	*国庫短期証券(1135回)入札 (3ヶ月、60,000億円、1/30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