

Central Daily Market Report

2023年1月27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27日 需給速報	2023年1月30日 需給予想	2023年1月31日 当社予想			
銀行券	500	500	▲ 1,000			
財政	▲ 3,200	10,100	7,900			
資金過不足	▲ 2,700	10,600	6,900			
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						
CP等買入		▲ 500	4,000	▲ 1,000		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
新型コロナウイルス対応 気候変動対応オペ	2,500	▲ 8,100			28,300	▲ 20,500
E T F買入						
国債補完供給	▲ 77,600	77,100		77,600		
※ドル資金供給用担保提供額						
当増減	▲ 9,300		99,000			6,900
当座預金残高	5,202,800		5,301,800			5,308,700
準備預金残高	4,547,200					
積み終了先	4,546,500			1月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,545,000			積数		6,400
非準備預金先	655,600			1日平均		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	99.84%	日数			45.16%

●2023年1月27日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末3日積みとなったものの、レート水準に大きな変化はなく、前日比で概ね横ばい圏での推移となった。立ち上がりは、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。一巡後は、レート水準がやや低下し、▲0.02%台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。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.085%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>

27日はTB3M物(第1135回)の入札が実施され、事前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は、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、月末発行にあたり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

2023/1/27	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.014					-	▲ 0.092	0.475	0.015	27,382.56	19.81	129.80-82	129.94-96
T/N								-	▲ 0.097						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.010	▲ 0.002	▲ 0.005					-	▲ 0.113						
2W	▲ 0.030	▲ 0.025	▲ 0.028					-	▲ 0.127						
3W								-	▲ 0.137						
1M			▲ 0.025					-	▲ 0.144						
3M			0.015					▲ 0.172	▲ 0.143						
6M								▲ 0.115	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.078	▲ 0.081						
日付	1/20	1/23	1/24	1/25	1/26										
日銀当預残	5,105,500	5,132,600	5,139,600	5,178,700	5,212,100										
準備預金残	4,452,600	4,470,200	4,478,100	4,516,100	4,546,200										
マネタリーベース	6,380,100	6,406,300	6,412,400	6,451,100	6,485,000										
無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.012%	▲ 0.015%	▲ 0.014%	▲ 0.014%										
コール市場残高	211,305	202,686	203,913	199,873	205,801										
うち無担	180,860	173,686	174,865	171,009	173,553										
うちO/N	116,484	108,410	106,169	101,563	103,507										
うち有担	30,445	29,000	29,048	28,864	32,248										

●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)
国庫短期証券	1135	-	60,000	2023/1/30	2023/5/8	141,995.0	48,729.6	100.0380	▲0.1414%	57.4435%	100.0416	▲0.1548%	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		2023/1/30		0.040	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		2023/1/30		0.195	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/27	2023/1/30	▲0.350	77,743	77,743		▲0.350	▲0.357	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/27	2023/1/30	▲0.350	3	3		▲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。

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
気候変動対応支援オペ	2023/1/30	2024/1/30	0	28,261

●2023年1月30日の予定

*特にありません

◆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