

Central Daily Market Report

2023年1月30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30日 需給速報	2023年1月31日 需給予想	2023年2月1日 当社予想			
銀行券	500	400	500			
財政	11,100	10,100	▲ 39,100			
資金過不足	11,600	10,500	▲ 38,600			
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		18,400				
CP等買入	4,000	▲ 1,000	▲ 2,500			
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金融支援特別 気候変動対応オペ	28,300	▲ 20,500				
E T F買入						
国債補完供給	▲ 76,800	77,600	76,800			
当増増減	23,200	103,200	▲ 38,600			
当座預金残高	5,226,000	5,329,200	5,290,600			
準備預金残高	4,556,700					
積み終了先	4,555,800			1月31日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,555,800			積数	5,600	
非準備預金先	669,300			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	99.86%	日数	48.39%		

●2023年1月30日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末要因が剥落したものの、レート水準に大きな変化は見られず、前営業日から概ね横這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、▲0.095~▲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>

30日のアウトライ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発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横這い圏であった。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

2023/1/30	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	売買参考統計値	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	▲ 0.014					-	▲ 0.092	0.475	0.000	27,433.40	50.84	129.83-86	129.59-61
T/N								-	▲ 0.097						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W								-	▲ 0.115						
2W	▲ 0.020	▲ 0.010	▲ 0.015					-	▲ 0.125						
3W								-	▲ 0.136						
1M								-	▲ 0.142						
3M								▲ 0.172	▲ 0.142						
6M								▲ 0.115	▲ 0.103						
1Y								▲ 0.078	▲ 0.080						
日付	1/23	1/24	1/25	1/26	1/27										
日銀当預残	5,132,600	5,139,600	5,178,700	5,212,100	5,202,800										
準備預金残	4,470,200	4,478,100	4,516,100	4,546,200	4,547,200										
マネタリーベース	6,406,300	6,412,400	6,451,100	6,485,000	6,475,200										
無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.015%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%										
コール市場残高	202,686	203,913	199,873	205,801	202,358										
うち無担	173,686	174,865	171,009	173,553	172,193										
うちO/N	108,410	106,169	101,563	103,507	100,247										
うち有担	29,000	29,048	28,864	32,248	30,165										

●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)	授分レート ・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	授分 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		2023/1/31		0.025	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		2023/1/31		0.131	0	0				
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/1/31			6,984	5,001	▲0.016		▲0.009	5.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	6,750	2023/1/31			12,139	6,753	▲0.014		▲0.009	20.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	4,000	2023/1/31			8,165	4,009	▲0.019		▲0.016	22.5
国債買入(残存期間25年超)	2,000	2023/1/31			3,776	2,011	0.006		0.008	33.2
国債買入(物価連動債)	600	2023/1/31			2,568	601	▲0.450		▲0.549	77.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/30	2023/1/31	▲0.350	77,160	77,160		▲0.350	▲0.358	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/30	2023/1/31	▲0.350	107	107		▲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。

●2023年1月31日の予定

*12月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*米FOMC(1日目)	*2年利付国債入札
*12月の有効求人倍率(市場予想:1.36倍)	*11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	(29,000億円、2/1発行)
*12月の商業動態統計速報	*1月のシカゴPM景況感指数	*交付税特別会計借入
*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報	*10-12月期のユーロ圏GDP1次速報	(12,000億円、2/8借入)
(市場予想:前月比▲1.2%)		
*12月の住宅着工統計	*1月の消費動向調査	

◆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