

Central Daily Market Report

2023年1月31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31日 需給速報	2023年2月1日 需給予想	2023年2月2日 当社予想			
銀行券	400	800	500			
財政	7,400	▲ 33,300	▲ 57,000			
資金過不足	7,800	▲ 32,500	▲ 56,500			
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			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	18,400		400			
CP等買入		▲ 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						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 73,400	71,300		73,400		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	21,600	52,300	▲ 56,500			
当座預金残高	5,247,600	5,299,900	5,243,400			
準備預金残高	4,584,300					
積み終了先	4,583,400			2月1日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,583,300			積数	4,700	
非準備預金先	663,300			1日平均	300	
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	99.88%	日数	51.61%		

●2023年1月31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~▲0.012%近辺での出会いとなった。調達サイドの一部にレート目線を引き下げる動きが見られたものの、水準に大きな変化はなく、昨日比で概ね横這い圏での推移となった。
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~▲0.095%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>

31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、無難な結果となった。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、案件が少なく閑散とした状況となった。発行レートは、概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2023/1/31	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.014					-	▲ 0.111	0.490	0.015	27,327.11	▲ 106.29	130.47-49	130.14-16
T/N								-	▲ 0.100						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.025					-	▲ 0.117						
2W								-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.137						
1M			▲ 0.025					-	▲ 0.144						
3M								▲ 0.172	▲ 0.142						
6M								▲ 0.115	▲ 0.103						
1Y								▲ 0.078	▲ 0.079						
日付	1/24	1/25	1/26	1/27	1/30										
日銀当預残	5,139,600	5,178,700	5,212,100	5,202,800	5,226,000										
準備預金残	4,478,100	4,516,100	4,546,200	4,547,200	4,556,700										
マネタリーベース	6,412,400	6,451,100	6,485,000	6,475,200	6,497,800										
無担O/N加重平均	▲ 0.015%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.014%										
コール市場残高	203,913	199,873	205,801	202,358	200,302										
うち無担	174,865	171,009	173,553	172,193	170,786										
うちO/N	106,169	101,563	103,507	100,247	98,840										
うち有担	29,048	28,864	32,248	30,165	29,516										

●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非償還競争入札(億円)	非競争入札(億円)
2年利付国債	445	0.005%	29,000	2023/2/1	2025/2/1	87,880.0	23,581.00	100.0250	▲0.0070%	88.9171%	100.0290	▲0.0090%	5,413	
交付税特会	-	-	12,000	2023/2/8	2023/8/8	402,856.0	11,990.35		0.0000%	2.9764%		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	2023/2/1			4,699	1,000		0.009	0.009	
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/2/1		0.025	423	423				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/2/1		0.130	0	0				
米ドル資金供給		2023/2/2	2023/2/9	4.810	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/31	2023/2/1	▲0.350	73,806	73,806		▲0.350	▲0.359	
共通担保資金供給(全店)＜金利入札方式＞	10,000	2023/2/1	2028/2/1		32,639	10,004	0.100		0.142	32.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/31	2023/2/1	▲0.350	0	0				

*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2月1日の予定

*米FOMC(2日目)	*1月のISM 製造業景況指数	*1月のユーロ圏消費者物価指数速報値
*12月の米建設支出	*1月の米CB消費者信頼感指数	

◆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