

Central Daily Market Report

2023年1月10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10日 需給速報 | 2023年1月11日 需給予想 | 2023年1月12日 当社予想 | | | |
|------------------------|--------------------|--------------------|--------------------|---------|-----------------|-----------|
| 銀行券 | 2,800 | 2,700 | 2,500 | | | |
| 財政 | ▲ 20,800 | 48,000 | ▲ 78,000 | | | |
| 資金過不足 | ▲ 18,000 | 50,700 | ▲ 75,500 | | | |
| 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 | 20,000 | | 1,400 | ▲ 4,700 | | |
| 国債買現 | | | | | | |
| 国債売現 | | | | | | |
| 国庫短期証買入 | | | | | | |
| 国債買入 | 24,100 | | 2,600 | | | |
| CP等買入 | | ▲ 100 | | | | |
| 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 | ▲ 36,700 | 25,700 | 36,700 | | | |
| ※下ル資金供給用国債補充供給 | | | | | | |
| 当預増減 | 15,000 | | 86,700 | | | ▲ 75,500 |
| 当座預金残高 | 5,021,600 | | 5,108,300 | | | 5,032,800 |
| 準備預金残高 | 4,391,100 | | | | | |
| 積み終了先 | 4,391,000 | | | | 1月11日以降の残り所要積立額 | |
| 超過準備 | 4,391,000 | | | | 積数 | 200 |
| 非準備預金先 | 630,500 | | | | 1日平均 | 0 |
| 積み期間(12/16~1/15)の所要準備額 | | | | | | 3,901,400 |
| 準備預金進捗率 | 実績 | 99.99% | | | 日数 | 83.87% |

●2023年1月10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事から、レート水準は前営業日に比べやや低下する展開となった。立ち上がりは、邦銀業態からの調達を中心に▲0.05~▲0.02%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、▲0.07~▲0.04%近辺で散発的な出会いが見られた程度で、取引を終了した。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見されたが、積み期間の切り替わりを控え、慎重姿勢の参加者も多く動意に乏しい展開となった。

<レボ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲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>

本日の短国市場は、3M物の入札が延期となる中、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、一部で大型発行も見られた。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

| 2023/1/10 単位：% | 無担(速報) | | | 有担(速報) | | | 短国 | 東京 レボレート | JGB新発10年債 | | 日経平均株価 | | ドル/円 | |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|----|---------|-------------|-----------|-------|-----------|--------|-----------|-----------|
| | 最低 | 最高 | 平均 | 最低 | 最高 | 平均 | 発表参考統計値 | 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 | ▲ 0.080 | 0.001 | ▲ 0.027 | | | | - | ▲ 0.092 | 0.500 | 0.000 | 26,175.56 | 201.71 | 131.72-74 | 132.22-23 |
| T/N | | | | | | | - | ▲ 0.100 | | | | | | |
| S/N | | | | | | | - | - | | | | | | |
| 1W | ▲ 0.035 | ▲ 0.023 | ▲ 0.029 | | | | - | ▲ 0.107 | | | | | | |
| 2W | ▲ 0.055 | ▲ 0.025 | ▲ 0.046 | | | | - | ▲ 0.114 | | | | | | |
| 3W | | | | | | | - | ▲ 0.119 | | | | | | |
| 1M | | | | | | | - | ▲ 0.126 | | | | | | |
| 3M | 0.001 | 0.030 | 0.014 | | | | ▲ 0.120 | ▲ 0.127 | | | | | | |
| 6M | | | | | | | ▲ 0.115 | ▲ 0.110 | | | | | | |
| 1Y | | | | | | | ▲ 0.065 | ▲ 0.099 | | | | | | |
| 日付 | 12/29 | 12/30 | 1/4 | 1/5 | 1/6 | | | | | | | | | |
| 日銀当預残 | 5,025,800 | 5,024,900 | 5,017,400 | 5,044,400 | 5,006,600 | | | | | | | | | |
| 準備預金残 | 4,418,000 | 4,425,700 | 4,375,300 | 4,394,200 | 4,386,600 | | | | | | | | | |
| マネタリーベース | 6,325,700 | 6,324,100 | 6,314,100 | 6,338,200 | 6,297,200 | | | | | | | | | |
| 無担O/N加重平均 | ▲ 0.033% | ▲ 0.022% | ▲ 0.038% | ▲ 0.039% | ▲ 0.015% | | | | | | | | | |
| コール市場残高 | 181,377 | 137,335 | 159,725 | 168,453 | 191,025 | | | | | | | | | |
| うち無担 | 153,422 | 112,220 | 131,091 | 139,789 | 159,517 | | | | | | | | | |
| うちO/N | 83,171 | 72,972 | 76,414 | 81,598 | 99,396 | | | | | | | | | |
| うち有担 | 27,955 | 25,115 | 28,634 | 28,664 | 31,508 | | | | | | | | | |

●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 | 案分率 | 募入平均価格 | 募入平均利回 | 第1非価格競争入札(億円) |
|---|----|------|-------|-----|-----|---------|---------|-------|--------|-----|--------|--------|---------------|
| 1月10日(火)に実施を予定しておりました国庫短期証券(第1131回)の入札につきましては、日銀ネットが一部利用できない状況にあったことから、延期されました。 | | | | | | | | | | | | | |

●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) | 発札総額(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 | 平均発札レート・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 | | 2023/1/11 | | 0.000 | 2,628 | 2,628 | | | | |
| 国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2 | | 2023/1/11 | | 0.055 | 0 | 0 | | | | |
| 米ドル資金供給 | | 2023/1/12 | 2023/1/19 | 4.580 | 0 | 0 | | | | |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2023/1/10 | 2023/1/11 | ▲ 0.350 | 37,110 | 37,110 | | ▲ 0.350 | ▲ 0.350 | |
| 共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉 | | 2023/1/11 | 2023/1/25 | | 1,359 | 1,359 | | | | |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2023/1/10 | 2023/1/11 | ▲ 0.350 | 60 | 60 | | ▲ 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11日の予定

| | |
|--|--|
| *12月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *11月の景気動向指数速報 | *国庫短期証券(1131回)(3ヶ月、60,000億円、1/12発行) *30年利付国債入札(9,000億円、1/12発行) *交付税特別会計借入(13,000億円、1/19借入) |
|--|--|

◆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いますが、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等をお読みください。
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