

# Central Daily Market Report

2023年1月25日(水)

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25日 需給速報	2023年1月26日 需給予想	2023年1月27日 当社予想			
銀行券	300	▲ 300	2,500			
財政	30,700	18,900	▲ 9,000			
資金過不足	31,000	18,600	▲ 6,500			
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	5,800	▲ 1,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			19,400			
CP等買入		▲ 600		▲ 200		
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		▲ 400		
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						▲ 8,100
ETF買入						
国債補充供給	▲ 74,200	77,900		74,200		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	39,100		111,600		▲ 14,600	
当座預金残高	5,178,700		5,290,300		5,275,700	
準備預金残高	4,516,100					
積み終了先	4,514,200			1月26日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,514,200			積数	14,700	
非準備預金先	662,600			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	99.62%	日数	32.26%		

## ●2023年1月25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%近辺での出会いとなった。レート水準は、一巡後にやや低下したものの、概ね前日から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~▲0.085%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>

25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。

また、本日はCP等買入オペが事前予定通り4,000億円で実施され、按分落札レート0.005%、平均落札レート0.029%と、前回(按分0.002%、平均0.010%)比で按分・平均ともに上昇となった。

## ●短期金融市場関連指標

2023/1/25	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					-	▲ 0.093	0.435	0.030	27,395.01	95.82	130.21-23	130.43-45
T/N								-	▲ 0.097						
S/N			▲ 0.005					-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.010	▲ 0.020					-	▲ 0.114						
2W	▲ 0.035	▲ 0.008	▲ 0.028					-	▲ 0.126						
3W								-	▲ 0.141						
1M								-	▲ 0.144						
3M			0.028					▲ 0.175	▲ 0.143						
6M								▲ 0.115	▲ 0.106						
1Y								▲ 0.077	▲ 0.082						
日付	1/18	1/19	1/20	1/23	1/24										
日銀当預残	5,123,400	5,126,600	5,105,500	5,132,600	5,139,600										
準備預金残	4,478,400	4,469,100	4,452,600	4,470,200	4,478,100										
マネタリーベース	6,399,500	6,402,200	6,380,100	6,406,300	6,412,400										
無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.012%	▲ 0.015%										
コール市場残高	203,097	209,218	211,305	202,686	203,913										
うち無担	175,278	179,564	180,860	173,686	174,865										
うちO/N	111,237	119,978	116,484	108,410	106,169										
うち有担	27,819	29,654	30,445	29,000	29,048										

## ●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。

## ●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		2023/1/26		0.095	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		2023/1/26		0.196	0	0				
国債買入(残存期間1年超3年以下)	5,000	2023/1/26			7,517	5,002	▲0.008		▲0.004	28.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	5,000	2023/1/26			10,305	5,005	▲0.007		▲0.004	81.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	5,750	2023/1/26			15,180	5,757	▲0.004		▲0.002	26.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	3,000	2023/1/26			7,522	3,004	▲0.005		▲0.004	92.1
CP等買入	4,000	2023/1/30			10,400	3,980	0.005		0.029	28.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/1/25	2023/1/26	▲0.350	74,200	74,200		▲0.350	▲0.360	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/1/25	2023/1/26	▲0.350	0	0				

\*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26日の予定

*決定会合における主な意見 (1月17・18日分)	*10-12月期の米GDP速報値 *12月の米新築一戸建て販売件数 *12月の米耐久財新規受注	*40年利付国債入札 (7,000億円、1/27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