

# Central Daily Market Report

2024年1月4日(木)

セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

単位: 億円	2024年1月4日 需給速報	2024年1月5日 需給予想	2024年1月9日 当社予想			
銀行券	2,300	3,000	2,000			
財政	2,200	▲ 2,800	▲ 41,000			
資金過不足	4,500	200	▲ 39,000			
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						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 44,600	41,800	44,600			
当預増減	1,700	44,800	▲ 39,000			
当座預金残高	5,438,500	5,483,300	5,444,300			
準備預金残高	4,722,000					
積み終了先	4,721,200			1月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,721,200			積数	1,900	
非準備預金先	716,500			1日平均	200	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					3,969,100	
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	64.52%		

## ●2024年1月4日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.04~▲0.015%近辺での出合いが始まった。年末要因の剥落により、資金調達を再開する動きが見られた。それに伴いビッド件数が増加した事もあり、出合いの中心レートは前営業日比で上昇した。  
ターム物はショートターム物での引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.090%程度での出合いとなった。  
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>

4日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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ばい圏であった。

## ●短期金融市場関連指標

2024/1/4	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考値	東京 レポレート 平均値	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	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.021				-	▲ 0.088	0.615	0.000	33,288.29	▲ 175.88	142.96-99	143.37-39
T/N			▲ 0.018				-	▲ 0.105						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	0.020	▲ 0.029				-	▲ 0.120						
2W	▲ 0.028	0.200	▲ 0.010				-	▲ 0.127						
3W							-	▲ 0.134						
1M	▲ 0.013	0.480	0.033				-	▲ 0.134						
3M							▲ 0.200	▲ 0.141						
6M							▲ 0.160	▲ 0.097						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.060						
									日付	12/25	12/26	12/27	12/28	12/29
									日銀当預残	5,453,200	5,454,100	5,449,700	5,440,900	5,436,800
									準備預金残	4,744,000	4,741,400	4,733,800	4,709,100	4,736,100
									マネタリーベース	6,740,100	6,743,400	6,741,000	6,734,900	6,730,500
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.011%	▲0.013%	▲0.016%	▲0.039%
									コール市場残高	202,992	204,971	205,902	202,268	139,628
									うち無担	175,618	179,081	179,163	174,810	115,456
									うちO/N	82,646	86,104	86,026	83,923	66,708
									うち有担	27,374	25,890	26,739	27,458	24,172

## ●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/4	2024/1/5	▲ 0.350	44,841	44,841		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/4	2024/1/5	▲ 0.350	0	0				

## ●2024年1月5日の予定

*12月のマネタリーベース	*12月の米雇用統計	*国庫短期証券(1204回)入札(3ヶ月、56,000億円、1/9発行)
*12月の消費動向調査	*12月のISM非製造業景況指数	*流動性供給入札(5,000億円、1/9発行)
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*11月の米製造業新規受注・出荷・在庫	
	*12月のユーロ圏消費者物価指数速報値	

◆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