

# Central Daily Market Report

2024年1月5日(金)

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5日 需給速報	2024年1月9日 需給予想	2024年1月10日 当社予想			
銀行券	3,200	3,100	3,000			
財政	2,400	▲ 38,500	1,000			
資金過不足	5,600	▲ 35,400	4,000			
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						▲ 12,600
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 債権等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 43,300	44,600		43,300		
当預増減	6,900	7,900		▲ 8,600		
当座預金残高	5,445,400	5,453,300	5,444,700			
準備預金残高	4,735,900					
積み終了先	4,735,700			1月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,735,600			積数	600	
非準備預金先	709,500			1日平均	100	
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	99.98%	日数	77.42%		

## ●2024年1月5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▲0.025~▲0.005%近辺での出合いが始まった。3連休前の4日積みとなった事で、ビッドサイドからは旺盛な資金調達ニーズが見られたため、出合いの水準は前日比で上昇する展開となった。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、▲0.100~▲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>

5日はTB3M物(第1204回)の入札が実施され、やや強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は、一部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。

## ●短期金融市場関連指標

2024/1/5	無担(速報)			有担(速報)			短国 売買参考統計値	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.087	0.600	▲ 0.015	33,377.42	+89.13	144.76-78	145.06-08
T/N			▲ 0.013				-	▲ 0.096						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.030	▲ 0.002	▲ 0.025				-	▲ 0.116						
2W	▲ 0.028	▲ 0.003	▲ 0.023				-	▲ 0.124						
3W							-	▲ 0.129						
1M	▲ 0.015	▲ 0.002	▲ 0.011				-	▲ 0.133						
3M			0.020				▲ 0.185	▲ 0.139						
6M							▲ 0.160	▲ 0.097						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.061						
									日付	12/26	12/27	12/28	12/29	1/4
									日銀当預残	5,454,100	5,449,700	5,440,900	5,436,800	5,438,500
									準備預金残	4,741,400	4,733,800	4,709,100	4,736,100	4,721,600
									マネタリーベース	6,743,400	6,741,000	6,734,900	6,730,500	6,729,900
									無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.013%	▲ 0.016%	▲ 0.039%	▲ 0.021%
									コール市場残高	204,971	205,902	202,268	139,628	169,134
									うち無担	179,081	179,163	174,810	115,456	142,284
									うちO/N	86,104	86,026	83,923	66,708	73,846
									うち有担	25,890	26,739	27,458	24,172	26,850

## ●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)	募入最低値	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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1204	-	56,000	2024/1/9	2024/4/8	147,769.2	45,471.7	100.0400	▲ 0.1621%	41.7203%	100.0438	▲ 0.1775%	10,528
流動性供給	397	-	5,000	2024/1/9	-	22,163	4,980		▲ 0.008%	99.6998%		▲ 0.009%	

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/5	2024/1/9	▲ 0.350	43,580	43,580		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/5	2024/1/9	▲ 0.350	0	0				

## ●2024年1月8日の予定

*成人の日	*11月の米消費者信用残高
-------	---------------

## ●2024年1月9日の予定

*1月の日銀当座預金増減要因見込み	*11月の米貿易収支	*国庫短期証券(1205回)入札(6ヶ月、40,000億円、1/10発行)
*12月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.1%)		
*11月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲2.3%)		

◆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。  
◆本資料は何ら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