

Central Daily Market Report

2024年1月9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	2024年1月9日 需給速報	2024年1月10日 需給予想	2024年1月11日 当社予想
銀行券	3,200	2,700	1,000
財政	▲ 33,500	▲ 2,900	▲ 33,000
資金過不足	▲ 30,300	▲ 200	▲ 32,000

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			8,400	▲ 12,600		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			9,500			
CP等買入				▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 債権等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 39,700	43,300		39,700		
当増減	▲ 26,700		44,300		▲ 32,000	

当座預金残高	5,418,700	5,463,000	5,431,000	
準備預金残高	4,724,400			
積み終了先	4,724,200	1月10日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,724,200	積数	400	
非準備預金先	694,300	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	99.99%	日数	80.65%

●2024年1月9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%近辺での出会いとなった。3連休要因が剥落したものの、引き続きビッドサイドからの資金調達ニーズは強く、出会い水準は前営業日対比で横ばい圏の推移となった。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、▲0.125~▲0.100%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>

9日はTB6M物(第1205回)の入札が実施され、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

2024/1/9	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)	為替(17時)	
O/N	▲ 0.080	0.001	▲ 0.017				-	▲ 0.089	0.580	▲ 0.020	33,763.18	+385.76	144.21-23	144.06-07		
T/N			▲ 0.018				-	▲ 0.097								
S/N							-	-								
1W	▲ 0.035	0.001	▲ 0.018				-	▲ 0.118								
2W	▲ 0.026	▲ 0.008	▲ 0.022				-	▲ 0.126								
3W			0.001				-	▲ 0.131								
1M			0.255				-	▲ 0.135								
3M			0.018				▲ 0.200	▲ 0.142								
6M							▲ 0.172	▲ 0.096								
1Y							▲ 0.050	▲ 0.061								
											日付	12/27	12/28	12/29	1/4	1/5
											日銀当預残	5,449,700	5,440,900	5,436,800	5,438,500	5,445,400
											準備預金残	4,733,800	4,709,100	4,736,100	4,721,600	4,736,300
											マネタリーベース	6,741,000	6,734,900	6,730,500	6,729,900	6,733,600
											無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.016%	▲0.039%	▲0.021%	▲0.018%
											コール市場残高	205,902	202,268	139,628	169,134	180,502
											うち無担	179,163	174,810	115,456	142,284	153,847
											うちO/N	86,026	83,923	66,708	73,846	79,899
											うち有担	26,739	27,458	24,172	26,850	26,655

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1205	-	40,000	2024/1/10	2024/7/10	120,353	32,494.8	100.079	▲0.1583%	17.1034%	100.086	▲0.1723%	7,505

●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(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/1/10			9,233	3,752	▲0.009		▲0.008	85.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/1/10			8,678	4,256	▲0.009		▲0.008	97.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/1/10			3,288	1,503	▲0.015		▲0.011	29.6
米ドル資金供給		2024/1/11	2024/1/18	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/9	2024/1/10	▲0.350	39,661	39,661		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2024/1/10	2024/1/23	0.000	8,432	8,432				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/9	2024/1/10	▲0.350	152	152		▲0.350	▲0.350	

●2024年1月10日の予定

*11月の毎月勤労統計調査速報	*11月の米卸売売上高	*10年利付国債入札 (27,000億円、1/11発行)	*交付税特別会計借入 (13,000億円、1/18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