

Central Daily Market Report

2024年1月11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11日 需給速報	2024年1月12日 需給予想	2024年1月15日 当社予想			
銀行券	2,100	2,700	2,000			
財政	▲ 37,600	▲ 4,600	▲ 10,500			
資金過不足	▲ 35,500	▲ 1,900	▲ 8,500			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 300		▲ 600		
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 34,800	35,200		34,800		
当預増減	▲ 35,400	32,300		▲ 8,500		
当座預金残高	5,394,500	5,426,800		5,418,300		
準備預金残高	4,697,600					
積み終了先	4,697,600					
超過準備	4,697,600					
非準備預金先	696,900					
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額						4,033,600
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	87.10%		

●2024年1月11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▲0.02~▲0.005%近辺での出会いとなった。積み期間は終盤となってきたが、引き続きビッドサイドからの資金調達ニーズは強く、取り上がる先も多く見られたことから、全体のレート水準も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、▲0.13~▲0.10%程度での出会いとなった。
SCI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>

11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4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート+0.003%、平均落札レート+0.018%と、前回(按分+0.005%・平均+0.023%)比で按分、平均ともに低下した。

●短期金融市場関連指標

2024/1/11	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	
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考指標	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	▲ 0.014				-	▲ 0.095	0.600	▲ 0.015	35,049.86	+608.14	145.72-74	145.39-41
T/N	▲ 0.015	0.030	▲ 0.006				-	▲ 0.107						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.009	▲ 0.034				-	▲ 0.122						
2W							-	▲ 0.129						
3W							-	▲ 0.132						
1M							-	▲ 0.141						
3M							▲ 0.200	▲ 0.148						
6M							▲ 0.183	▲ 0.096						
1Y							▲ 0.050	▲ 0.061						
									日付	12/29	1/4	1/5	1/9	1/10
									日銀当預残	5,436,800	5,438,500	5,445,400	5,418,700	5,429,900
									準備預金残	4,736,100	4,721,600	4,736,300	4,725,100	4,713,000
									マネタリーベース	6,730,500	6,729,900	6,733,600	6,703,800	6,712,300
									無担O/N加重平均	▲ 0.039%	▲ 0.021%	▲ 0.018%	▲ 0.017%	▲ 0.016%
									コール市場残高	139,628	169,134	180,502	184,233	192,616
									うち無担	115,456	142,284	153,847	158,831	167,357
									うちO/N	66,708	73,846	79,899	80,568	83,934
									うち有担	24,172	26,850	26,655	25,402	25,259

●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)
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*	応募総額(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
CP等買入	4,000	2024/1/16			6,890	3,980	0.003		0.018	65.1
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/11	2024/1/12	▲ 0.350	34,917	34,917		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/11	2024/1/12	▲ 0.350	50	50		▲ 0.350	▲ 0.358	

●2024年1月12日の予定

*11月の国際収支	*12月の米生産者物価指数	*国庫短期証券(1206回)入札(3ヶ月、56,000億円、1/15発行)
*12月の景気ウォッチャー調査		*30年利付国債入札(9,000億円、1/15発行)
		*エネルギー対策借入(7,300億円、1/22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