

Central Daily Market Report

2024年1月12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12日 需給速報	2024年1月15日 需給予想	2024年1月16日 当社予想			
銀行券	2,800	1,900	1,500			
財政	▲ 8,200	▲ 14,900	▲ 1,500			
資金過不足	▲ 5,400	▲ 13,000	0			
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		▲ 600	▲ 200	4,000		
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	▲ 35,300	34,800	35,300			
* F L 資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 6,500	22,100	4,000			
当座預金残高	5,388,000	5,410,100	5,414,100			
準備預金残高	4,693,500					
積み終了先	4,693,500			1月15日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,693,500			積数	0	
非準備預金先	694,500			1日平均	0	
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	96.77%		

●2024年1月12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▲0.015~▲0.005%近辺での出会いとなった。引き続きビッドサイドからの資金調達ニーズが強いなか、今積み期最後の週末3日積みとなり、レートを切り上げて調達する先も多く見られたことから、出会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。

<レボ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.095%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>

12日はTB3M物(第1206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も、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。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

2024/1/12	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レボレート	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	▲ 0.075	0.010	▲ 0.010					-	▲ 0.096	0.585	▲ 0.015	35,577.11	+527.25	145.09-11	145.14-16
T/N			▲ 0.009					-	▲ 0.103						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.010					-	▲ 0.121						
2W	▲ 0.003	0.050	0.015					-	▲ 0.130						
3W								-	▲ 0.131						
1M	▲ 0.007	0.100	0.014					-	▲ 0.137						
3M								▲ 0.215	▲ 0.149						
6M								▲ 0.185	▲ 0.095						
1Y								▲ 0.050	▲ 0.061						
									日付	1/4	1/5	1/9	1/10	1/11	
									日銀当預残	5,438,500	5,445,400	5,418,700	5,429,900	5,394,500	
									準備預金残	4,721,600	4,736,300	4,725,100	4,713,000	4,698,500	
									マネタリーベース	6,729,900	6,733,600	6,703,800	6,712,300	6,674,900	
									無担O/N加重平均	▲ 0.021%	▲ 0.018%	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.014%	
									コール市場残高	169,134	180,502	184,233	192,616	198,851	
									うち無担	142,284	153,847	158,831	167,357	172,836	
									うちO/N	73,846	79,899	80,568	83,934	89,553	
									うち有担	26,850	26,655	25,402	25,259	26,015	

●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1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1206	-	56,000	2024/1/15	2024/4/15	145,315	45,471.5	100.0485	▲0.1944%	25.3491%	100.0519	▲0.2080%	10,528
30年利付国債	81	1.6%	9,000	2024/1/15	2053/12/20	21,817	7,264	99.00	1.649%	54.7563%	99.40	1.629%	1,728
エネルギー対策	-	-	7,300	2024/1/22	2025/1/20	83,000	7,299.99		0.000%	12.5646%		0.000%	

●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)		2024/1/12	2024/1/15	▲ 0.350	35,441	35,441		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/12	2024/1/15	▲ 0.350	0	0				

●2024年1月15日の予定

*12月のマネーストック

*11月の特定サービス産業動態統計速報

*New York祝日(Martin L. King Jr.'s Day)

◆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ことがあります。金融商品取引法に基づきお渡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