

# Central Daily Market Report

2024年1月15日(月)

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15日 需給速報	2024年1月16日 需給予想	2024年1月17日 当社予想			
銀行券	1,800	1,800	1,000			
財政	▲15,000	3,600	▲27,000			
資金過不足	▲13,200	5,400	▲26,000			
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			11,900			
CP等買入		▲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	▲33,400	35,300	33,400			
*F/L資金供給用担保提供額						
当増減	▲11,500	54,700	▲26,000			
当座預金残高	5,376,500	5,431,200	5,405,200			
準備預金残高	4,698,000					
積み終了先	4,698,000			1月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,698,000			積数	4,040,400	
非準備預金先	678,500			1日平均	130,300	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					4,040,400	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

## ●2024年1月15日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.008~▲0.004%程度での出会いが中心となった。積み最終日となったが、レートは高止まりが続いた。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、▲0.11~▲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>

15日のアウトライ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、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

2024/1/15	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	▲0.009					-	▲0.095	0.555	▲0.030	35,901.79	+324.68	145.15-16	145.44-45
T/N			▲0.027					-	▲0.110						
S/N								-	-						
1W	▲0.005	▲0.004	▲0.005					-	▲0.120						
2W	▲0.025	▲0.010	▲0.023					-	▲0.131						
3W	0.090	0.100	0.095					-	▲0.130						
1M	▲0.010	▲0.007	▲0.009					-	▲0.137						
3M	0.028	0.035	0.031					▲0.220	▲0.147						
6M								▲0.185	▲0.095						
1Y								▲0.050	▲0.061						
										日付	1/5	1/9	1/10	1/11	1/12
										日銀当預残	5,445,400	5,418,700	5,429,900	5,394,500	5,388,000
										準備預金残	4,736,300	4,725,100	4,713,000	4,698,500	4,694,000
										マネタリーベース	6,733,600	6,703,800	6,712,300	6,674,900	6,665,500
										無担O/N加重平均	▲0.018%	▲0.017%	▲0.016%	▲0.014%	▲0.010%
										コール市場残高	180,502	184,233	192,616	198,851	187,514
										うち無担	153,847	158,831	167,357	172,836	161,905
										うちO/N	79,899	80,568	83,934	89,553	79,062
										うち有担	26,655	25,402	25,259	26,015	25,609

## ●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2024/1/16			5,307	1,500	▲0.003		0.005	20.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/1/16			10,850	3,755	▲0.005		▲0.004	72.8
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/1/16			13,066	4,760	▲0.037		▲0.033	53.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/1/16			4,078	1,503	▲0.040		▲0.035	37.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/15	2024/1/16	▲0.350	33,514	33,514		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/15	2024/1/16	▲0.350	0	0				

## ●2024年1月16日の予定

*12月の企業物価指数	*5年利付国債入札(25,000億円、1/17発行)	*交付税特別会計借入(13,000億円、1/25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