

# Central Daily Market Report

2024年1月16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16日 需給速報	2024年1月17日 需給予想	2024年1月18日 当社予想			
銀行券	1,800	1,300	2,000			
財政	4,600	▲ 25,900	1,000			
資金過不足	6,400	▲ 24,600	3,000			
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	4,000		▲ 100			
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	▲ 34,500	33,400	34,500			
当増減	21,200	9,800	3,000			
当座預金残高	5,397,700	5,407,500	5,410,500			
準備預金残高	4,701,200					
積み終了先	3,025,900			1月17日以降の残り所要積立額		
超過準備	1,251,800			積数	591,000	
非準備預金先	696,500			1日平均	19,700	
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	85.37%	日数	3.23%		

## ●2024年1月16日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.015%程度での出会いが中心となった。新しい積み期間に入り、オファーサイドの運用額がやや増加した印象があるものの、引き続きビッド件数も多く、調達ニーズの底堅い展開となった。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、▲0.10~▲0.09%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>

16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

2024/1/16	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		
	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	▲ 0.080	0.001	▲ 0.017					-	▲ 0.094	0.589	+0.034	35,619.18	▲ 282.61	145.79-80	146.15-17
T/N			▲ 0.015					-	▲ 0.101						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.027	0.001	▲ 0.015					-	▲ 0.121						
2W	▲ 0.025	▲ 0.002	▲ 0.021					-	▲ 0.126						
3W			0.100					-	▲ 0.128						
1M	▲ 0.020	▲ 0.008	▲ 0.014					-	▲ 0.136						
3M			0.010					▲ 0.225	▲ 0.149						
6M								▲ 0.195	▲ 0.095						
1Y								▲ 0.050	▲ 0.061						
										日付	1/9	1/10	1/11	1/12	1/15
										日銀当預残	5,418,700	5,429,900	5,394,500	5,388,000	5,376,500
										準備預金残	4,725,100	4,713,000	4,698,500	4,694,000	4,698,000
										マネタリーベース	6,703,800	6,712,300	6,674,900	6,665,500	6,652,200
										無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.016%	▲ 0.014%	▲ 0.010%	▲ 0.009%
										コール市場残高	184,233	192,616	198,851	187,514	186,094
										うち無担	158,831	167,357	172,836	161,905	159,931
										うちO/N	80,568	83,934	89,553	79,062	76,338
										うち有担	25,402	25,259	26,015	25,609	26,163

## ●入札結果

名称	回数	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)	非競争入札(億円)
5年利付国債	164	0.2%	25,000	2024/1/17	2028/12/20	76,827	20,280	99.98	0.204%	22.1710%	100.01	0.197%	4,703	10
交付税特会	-	-	13,000	2024/1/25	2024/7/25	508,096	12,990.37		0.000%	2.5567%		0.000%		10

## ●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
米ドル資金供給		2024/1/18	2024/1/25	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/16	2024/1/17	▲ 0.350	34,490	34,490		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/16	2024/1/17	▲ 0.350	5	5		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2024年1月17日の予定

*11月の米企業在庫	*12月のユーロ圏消費者物価指数改定値
*12月の米小売売上高	*12月の英消費者物価指数
*米ページブック	

◆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場合があります。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