

# Central Daily Market Report

2024年1月17日(水)  
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17日 需給速報	2024年1月18日 需給予想	2024年1月19日 当社予想			
銀行券	1,300	1,400	2,500			
財政	▲25,300	1,000	▲9,000			
資金過不足	▲24,000	2,400	▲6,500			
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		▲100		▲200		
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						
国債補充供給	▲34,000	34,500		34,000		
当増増減	▲23,600	36,200		▲6,500		
当座預金残高	5,374,100	5,410,300		5,403,800		
準備預金残高	4,698,300					
積み終了先	4,631,900					
超過準備	4,212,600					
非準備預金先	675,800					
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	97.40%	日数	6.45%		

## ●2024年1月17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~▲0.012%程度での出会いが中心となった。引き続きビッド件数は多く、調達ニーズの底堅い展開が続いた。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。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲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>

17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

2024/1/17	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				-	▲0.091	0.605	+0.016	35,477.75	▲141.43	147.23-25	147.87-88
T/N			▲0.012				-	▲0.097						
S/N			0.030				-	-						
1W	▲0.028	▲0.008	▲0.019				-	▲0.113						
2W	▲0.027	0.000	▲0.017				-	▲0.119						
3W			▲0.024				-	▲0.126						
1M			▲0.004				-	▲0.132						
3M							▲0.225	▲0.145						
6M							▲0.195	▲0.095						
1Y							▲0.050	▲0.058						
									日付	1/10	1/11	1/12	1/15	1/16
									日銀当預残	5,429,900	5,394,500	5,388,000	5,376,500	5,397,700
									準備預金残	4,713,000	4,698,500	4,694,000	4,698,000	4,701,200
									マネタリーベース	6,712,300	6,674,900	6,665,500	6,652,200	6,671,600
									無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.014%	▲0.010%	▲0.009%	▲0.017%
									コール市場残高	192,616	198,851	187,514	186,094	199,180
									うち無担	167,357	172,836	161,905	159,931	172,111
									うちO/N	83,934	89,553	79,062	76,338	87,538
									うち有担	25,259	26,015	25,609	26,163	27,069

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/17	2024/1/18	▲0.350	34,127	34,127		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/17	2024/1/18	▲0.350	0	0				

## ●2024年1月18日の予定

*11月の機械受注統計 (市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲0.8%)	*12月の米住宅着工件数 *12月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1207回)入札 (1年、35,000億円、1/22発行) *20年利付国債入札 (10,000億円、1/19発行)
--	-----------------------------------	---

◆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