

Central Daily Market Report

2024年1月18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18日 需給速報	2024年1月19日 需給予想	2024年1月22日 当社予想			
銀行券	1,500	1,400	500			
財政	▲ 6,800	▲ 5,500	▲ 3,000			
資金過不足	▲ 5,300	▲ 4,100	▲ 2,500			
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		▲ 200		▲ 800		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 200		
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 32,800	34,000		32,800		
当増減	▲ 4,300		27,700		▲ 2,500	
当座預金残高	5,369,800		5,397,500		5,395,000	
準備預金残高	4,685,300					
積み終了先						
超過準備	4,643,500					
非準備預金先	684,500					
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	98.44%	日数	9.68%		

●2024年1月18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~▲0.011%程度での出合いが中心となった。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、▲0.095~▲0.09%程度での出合いとなった。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>

18日はTB1Y物(第1207回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。その他、3M物でも出合いが見られた。

<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

2024/1/18	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	売買参考計値	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	▲ 0.014				-	▲ 0.091	0.650	+0.045	35,466.17	▲ 11.58	148.13-14	147.76-78
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.093						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.028	▲ 0.008	▲ 0.017				-	▲ 0.108						
2W	▲ 0.027	▲ 0.013	▲ 0.022				-	▲ 0.114						
3W							-	▲ 0.121						
1M	▲ 0.003	0.001	▲ 0.002				-	▲ 0.124						
3M							▲ 0.195	▲ 0.144						
6M							▲ 0.195	▲ 0.094						
1Y							▲ 0.075	▲ 0.058						
日付	1/11	1/12	1/15	1/16	1/17									
日銀当預残	5,394,500	5,388,000	5,376,500	5,397,700	5,374,100									
準備預金残	4,698,500	4,694,000	4,698,000	4,701,200	4,698,100									
マネタリーベース	6,674,900	6,665,500	6,652,200	6,671,600	6,646,700									
無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.017%	▲ 0.014%									
コール市場残高	198,851	187,514	186,094	199,180	198,465									
うち無担	172,836	161,905	159,931	172,111	171,707									
うちO/N	89,553	79,062	76,338	87,538	83,979									
うち有担	26,015	25,609	26,163	27,069	26,758									

●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	1207	-	35,000	2024/1/22	2025/1/20	117,829	28,429.6	100.046	▲0.0461%	59.8490%	100.055	▲0.0551%	6,570
20年利付国債	187	1.3%	10,000	2024/1/19	2043/12/20	25,373	8,117	98.45	1.399%	75.6386%	98.69	1.383%	1,873

●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
社債等買入	1,000	2024/1/23			2,443	1,000	0.310		0.327	25.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/18	2024/1/19	▲ 0.350	32,938	32,938		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/18	2024/1/19	▲ 0.350	0	0				

●2024年1月19日の予定

*12月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.3%)	*12月の米中古住宅販売 *1月のミシガン大消費者信頼感指数速報	*国庫短期証券(1208回)入札 (3ヶ月、56,000億円、1/22発行)
*11月の第3次産業活動指数		
*11月の石油等消費動態統計		

◆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