

# Central Daily Market Report

2024年1月22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22日 需給速報	2024年1月23日 需給予想	2024年1月24日 当社予想			
銀行券	900	1,200	1,000			
財政	1,900	▲ 4,000	▲ 1,500			
資金過不足	2,800	▲ 2,800	▲ 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			8,500	▲ 8,400		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	13,700					
CP等買入		▲ 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			1,000			
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 34,200	32,600	34,200			
当増減	14,700	32,500	▲ 500			
当座預金残高	5,377,200	5,409,700	5,409,200			
準備預金残高	4,684,600					
積み終了先	4,680,100			1月23日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,680,000			積数	27,900	
非準備預金先	692,600			1日平均	1,200	
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	99.31%	日数	22.58%		

## ●2024年1月22日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.013~▲0.010%程度での出会いが中心となった。引き続きビッド件数が多く、調達ニーズは底堅いものの、週末要因の剥落により若干落ち着きが見られた。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、▲0.090~▲0.075%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>

22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、数件の入札が実施された。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

2024/1/22	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.081	0.649	▲ 0.016	36,546.95	+583.68	148.12-13	148.04-05
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.081						
S/N							-	-						
1W			▲ 0.028				-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.025	▲ 0.023	▲ 0.024				-	▲ 0.108						
3W			▲ 0.009				-	▲ 0.115						
1M							-	▲ 0.121						
3M			0.020				▲ 0.187	▲ 0.140						
6M							▲ 0.190	▲ 0.097						
1Y							▲ 0.070	▲ 0.061						
									日付	1/15	1/16	1/17	1/18	1/19
									日銀当預残	5,376,500	5,397,700	5,374,100	5,369,800	5,362,500
									準備預金残	4,698,000	4,701,200	4,698,100	4,685,300	4,666,300
									マネタリーベース	6,652,200	6,671,600	6,646,700	6,640,900	6,632,000
									無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.017%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.011%
									コール市場残高	186,094	199,180	198,465	202,103	201,765
									うち無担	159,931	172,111	171,707	176,121	176,955
									うちO/N	76,338	87,538	83,979	83,843	80,547
									うち有担	26,163	27,069	26,758	25,982	24,810

## ●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第I非価格競争入札(億円)
流動性供給	398	-	5,000	2024/1/23	-	16,931	4,987		▲0.007%	71.8673%		▲0.010%	

## ●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/22	2024/1/23	▲ 0.350	34,284	34,284		▲ 0.350	▲ 0.350	
共通担保資金供給(全店) <固定金利・金額無制限>		2024/1/23	2024/2/7	0.000	8,452	8,452				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/22	2024/1/23	▲ 0.350	107	107		▲ 0.350	▲ 0.350	

## ●2024年1月23日の予定

- \*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)
- \*植田日銀総裁、定例会見
- \*経済・物価情勢の展望

◆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