

Central Daily Market Report

2024年1月23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23日 需給速報	2024年1月24日 需給予想	2024年1月25日 当社予想			
銀行券	1,200	700	2,000			
財政	▲ 3,900	▲ 4,500	12,000			
資金過不足	▲ 2,700	▲ 3,800	14,000			
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	8,500	▲ 8,400				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入						
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		▲ 100			
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 34,600	34,200	34,600			
*F/L資金供給用担保提供額						
当増減	▲ 2,000		30,700			14,000
当座預金残高	5,375,200	5,405,900	5,419,900			
準備預金残高	4,690,200					
積み終了先	4,687,900			1月24日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,686,700			積数	24,400	
非準備預金先	685,000			1日平均	1,100	
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	99.40%	日数	25.81%		

●2024年1月23日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.014~▲0.012%程度での出会いが中心となった。金融政策決定会合の結果公表を控えていたが、相場に大きな変化は見られず、引き続き調達ニーズの強い展開が継続された。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。

22日から23日に開催された日銀金融政策決定会合では、長短金利操作、資産買入れ方針、いずれも現状維持が決定された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲0.070%程度での出会いとなった。SC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>

23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発行市場は複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね幅広い圏で推移した。

●入札結果

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。

●短期金融市場関連指標

2024/1/23	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		▲ 0.085	0.001	▲ 0.014				-	▲ 0.078	0.635	▲ 0.014	36,517.57	▲ 29.38	148.12-13	147.57-59
T/N				▲ 0.010				-	▲ 0.075						
S/N								-	-						
1W		▲ 0.027	▲ 0.005	▲ 0.013				-	▲ 0.092						
2W				▲ 0.023				-	▲ 0.104						
3W								-	▲ 0.111						
1M								-	▲ 0.116						
3M								▲ 0.187	▲ 0.138						
6M								▲ 0.190	▲ 0.097						
1Y								▲ 0.090	▲ 0.061						
										日付	1/16	1/17	1/18	1/19	1/22
										日銀当預残	5,397,700	5,374,100	5,369,800	5,362,500	5,377,200
										準備預金残	4,701,200	4,698,100	4,685,300	4,666,300	4,685,000
										マネタリーベース	6,671,600	6,646,700	6,640,900	6,632,000	6,645,900
										無担O/N加重平均	▲ 0.017%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.011%	▲ 0.014%
										コール市場残高	199,180	198,465	202,103	201,765	203,969
										うち無担	172,111	171,707	176,121	176,955	175,536
										うちO/N	87,538	83,979	83,843	80,547	78,678
										うち有担	27,069	26,758	25,982	24,810	28,433

●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		2024/1/25	2024/2/1	5.580	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/23	2024/1/24	▲ 0.350	34,805	34,805		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/23	2024/1/24	▲ 0.350	1	1		▲ 0.350	▲ 0.350	

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

1. 日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。

(1) 長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)

① 次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針は、以下のとおりとする(全員一致)。

短期金利: 日本銀行当座預金のうち政策金利残高に▲0.1%のマイナス金利を適用する。

長期金利: 10年物国債金利がゼロ%程度で推移するよう、上限を設けず必要な金額の長期国債の買入れを行う。

② 長短金利操作の運用(全員一致)

長期金利の上限は1.0%を目標とし、上記の金融市場調節方針と整合的なイールドカーブの形成を促すため、大規模な国債買入れを継続するとともに、

各年限において、機動的に、買入れ額の増額や指値オペ、共通担保資金供給オペなどを実施する。

(2) 資産買入れ方針(全員一致)

長期国債以外の資産の買入れについては、以下のとおりとする。

① ETFおよびJ-R E T Iについて、それぞれ年間約12兆円、年間約1,800億円に相当する残高増加ペースを上限に、必要に応じて、買入れを行う。

② CP等は、約2兆円の残高を維持する。社債等は、感染症拡大前と同程度のペースで買入れを行い、買入れ残高を感染症拡大前の水準(約3兆円)へと徐々に戻していく。

ただし、社債等の買入れ残高の調整は、社債の発行環境に十分配慮して進めることとする。

●2024年1月24日の予定

*12月の貿易統計

*交付税特別会計借入(13,000億円、1/31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自身でなされたい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