

Central Daily Market Report

2024年1月26日(金)

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26日 需給速報	2024年1月29日 需給予想	2024年1月30日 当社予想			
銀行券	400	600	1,000			
財政	▲ 4,000	11,100	▲ 2,000			
資金過不足	▲ 3,600	11,700	▲ 1,000			
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						
CP等買入		▲ 400		▲ 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		▲ 200				
気候変動対応オペ						▲ 28,300
E T F買入						
国債補充供給	▲ 33,500	37,300		33,500		
* F L資金供給用担保提供額						
当増減	▲ 400		45,100		▲ 29,300	
当座預金残高	5,393,400		5,438,500		5,409,200	
準備預金残高	4,700,800					
積み終了先	4,698,900					
超過準備	4,698,500					
非準備預金先	692,600					
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	99.68%	日数	41.94%		

●2024年1月26日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.010~▲0.007%程度での出会いが中心となった。引き続き調達ニーズが強い中、3日積み要因も加わりレートは上昇した。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、▲0.080~▲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>

26日はTB3M物(第1209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。

<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、概ね横ばい圏で推移した。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でおfferされた。結果は按分レート+0.003%、平均落札レート+0.012%と、前回(按分+0.003、平均+0.018%)比で按分は横這い、平均は低下した。

●短期金融市場関連指標

2024/1/26	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	売買参考統計値	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	▲ 0.010					-	▲ 0.080	0.715	▲ 0.030	35,751.07	▲ 485.40	147.71-73	147.77-79
T/N			▲ 0.009					-	▲ 0.081						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.010					-	▲ 0.089						
2W								-	▲ 0.097						
3W								-	▲ 0.106						
1M								-	▲ 0.111						
3M								▲ 0.170	▲ 0.133						
6M								▲ 0.170	▲ 0.095						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.061						
										日付	1/19	1/22	1/23	1/24	1/25
										日銀当預残	5,362,500	5,377,200	5,375,200	5,366,300	5,393,800
										準備預金残	4,666,300	4,685,000	4,690,700	4,686,300	4,713,200
										マネタリーベース	6,632,000	6,645,900	6,642,700	6,633,000	6,660,100
										無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.013%	▲ 0.012%
										コール市場残高	201,765	203,969	192,509	198,971	200,437
										うち無担	176,955	175,536	165,747	170,603	172,360
										うちO/N	80,547	78,678	69,159	74,305	76,187
										うち有担	24,810	28,433	26,762	28,368	28,077

●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)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1209	-	56,000	2024/1/29	2024/5/7	123,748	45,471.5	100,0390	▲ 0.1437%	30.4878%	100.0419	▲ 0.1544%	10,528	
交付税特会	-	-	12,500	2024/2/5	2024/8/5	476,957	12,490.47		0.000%	2.6188%		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
CP等買入	4,000	2024/1/31			7,790	3,965	0.003		0.012	23.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/26	2024/1/29	▲ 0.350	33,870	33,870		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/26	2024/1/29	▲ 0.350	0	0				

●2024年1月29日の予定

*特にありません

◆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