

# Central Daily Market Report

2024年1月29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29日 需給速報	2024年1月30日 需給予想	2024年1月31日 当社予想			
銀行券	600	700	400			
財政	14,600	6,500	1,300			
資金過不足	15,200	7,200	1,700			
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			10,400			
CP等買入		▲100	▲600	4,000		
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			47,300	▲28,300		
ETF買入						
国債補充供給	▲36,000	33,500	36,000			
当増減	12,600	72,000	5,700			
当座預金残高	5,406,000	5,478,000	5,483,700			
準備預金残高	4,715,800					
積み終了先	4,714,000			1月30日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,714,000			積数	11,200	
非準備預金先	690,200			1日平均	700	
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	99.72%	日数	45.16%		

## ●2024年1月29日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.01~▲0.008%近辺の出会いで始まった。週末3日積み要因が剥落したものの、引き続きビッドサイドのニーズは強く、レート水準は高止まりとなった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レボ市場>

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>

29日のアウトラ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市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。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

2024/1/29	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	▲0.087	0.001	▲0.011					-	▲0.080	0.720	+0.005	36,026.94	+275.87	148.17-19	147.79-81
T/N			▲0.008					-	▲0.081						
S/N								-	-						
1W			▲0.020					-	▲0.089						
2W								-	▲0.099						
3W								-	▲0.105						
1M								-	▲0.109						
3M			0.026					▲0.170	▲0.128						
6M								▲0.170	▲0.093						
1Y								▲0.070	▲0.061						
日付	1/22	1/23	1/24	1/25	1/26										
日銀当預残	5,377,200	5,375,200	5,366,300	5,393,800	5,393,400										
準備預金残	4,685,000	4,690,700	4,686,300	4,713,200	4,700,600										
マネタリーベース	6,645,900	6,642,700	6,633,000	6,660,100	6,659,300										
無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.014%	▲0.013%	▲0.012%	▲0.010%										
コール市場残高	203,969	192,509	198,971	200,437	197,013										
うち無担	175,536	165,747	170,603	172,360	170,082										
うちO/N	78,678	69,159	74,305	76,187	74,949										
うち有担	28,433	26,762	28,368	28,077	26,931										

## ●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。

## ●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/1/30			11,596	4,254	0.006		0.007	94.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/1/30			13,145	4,760	0.007		0.009	11.6
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/1/30			2,428	753	0.022		0.025	60.1
国債買入(物価連動債)	600	2024/1/30			2,770	602	▲0.720		▲0.863	23.2
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/29	2024/1/30	▲0.350	36,285	36,285		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/29	2024/1/30	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	
種類		スタート日	エンド日	貸付 利率	貸付予定総額 (億円)					
気候変動対応支援オペ		2024/1/30	2025/1/30	0	47,268					

## ●2024年1月30日の予定

*12月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*米FOMC(1日目)	*2年利付国債入札
*12月の有効求人倍率(市場予想:1.28倍)	*11月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数	(29,000億円、2/1発行)
	*10-12月期のユーロ圏GDP1次速報	*交付税特別会計借入
		(12,500億円、2/8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場合があります。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