

Central Daily Market Report

2024年1月30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30日 需給速報	2024年1月31日 需給予想	2024年2月1日 当社予想			
銀行券	700	700	700			
財政	1,400	1,700	▲29,000			
資金過不足	2,100	2,400	▲28,300			
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			1,000			
国債買入	10,400					
CP等買入		▲600	4,000	▲2,000		
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	▲38,000	36,000		38,000		
*FDR資金供給用担保提供額						
当増減	28,900		43,400		▲28,300	
当座預金残高	5,434,900		5,478,300		5,450,000	
準備預金残高	4,739,900					
積み終了先	4,738,500					
超過準備	4,738,500					
非準備預金先	695,000					
1月31日以降の残り所要積立額				積数	9,900	
				1日平均	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	99.75%	日数	48.39%	

●2024年1月30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。引き続き幅広い業態から旺盛な資金調達ニーズが見られているため、レート水準は高止まりする展開が継続された。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.085~▲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>

30日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でもfferされ、弱めの結果となった。マーケットで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、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

2024/1/30	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	0.705	▲0.015	36,065.86	+38.92	147.48-50	147.23-25
T/N			▲0.007					-	▲0.086						
S/N								-	-						
1W	▲0.021	▲0.005	▲0.012					-	▲0.092						
2W			▲0.002					-	▲0.098						
3W			0.001					-	▲0.103						
1M	▲0.002	0.005	0.001					-	▲0.110						
3M								▲0.170	▲0.126						
6M								▲0.170	▲0.093						
1Y								▲0.070	▲0.061						
									コープ市場残高	192,509	198,971	200,437	197,013	209,290	
									うち無担	165,747	170,603	172,360	170,082	179,881	
									うちO/N	69,159	74,305	76,187	74,949	88,953	
									うち有担	26,762	28,368	28,077	26,931	29,409	

●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)
2年利付国債	457	0.1%	29,000	2024/2/1	2026/2/1	88,301	23,597	100.035	0.082%	57.0165%	100.049	0.075%	5,397	-
交付税特会	-	-	12,500	2024/2/8	2024/8/8	435,009	12,490.29		0.000%	2.8713%		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
国庫短期証券買入	1,000	2024/1/31			5,966	1,000	0.023		0.024	68.0
米ドル資金供給		2024/2/1	2024/2/8	5.570	3	3				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/30	2024/1/31	▲0.350	38,325	38,325		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/30	2024/1/31	▲0.350	0	0				
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2024/1/31	2024/2/9		2	2		▲0.100	▲0.100	

●2024年1月31日の予定

*決定会合における主な意見(1月22・23日分)
*12月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+2.4%)
*12月の商業動態統計速報 *12月の住宅着工統計
*1月の消費動向調査

*米FOMC(2日目)
*1月のシカゴPM景況感指数
*1月の米CB消費者信頼感指数

◆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