

Central Daily Market Report

2024年1月31日(水)

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31日 需給速報	2024年2月1日 需給予想	2024年2月2日 当社予想			
銀行券	700	300	1,000			
財政	▲ 3,500	▲ 29,400	▲ 100,000			
資金過不足	▲ 2,800	▲ 29,100	▲ 99,000			
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	1,000					
国債買入						
CP等買入	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						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 36,200	38,000		36,200		
当増減	2,000	7,100	▲ 99,000			
当座預金残高	5,436,900	5,444,000	5,345,000			
準備預金残高	4,727,900					
積み終了先	4,726,800			2月1日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,726,500			積数	8,500	
非準備預金先	709,000			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	99.79%	日数	51.61%		

●2024年1月31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%近辺の出会いが始まった。月末の取引日となり、調達を見合わせる先も一部で見られたが影響は少なく、レート水準は前日から概ね横ばい圏で推移した。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%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>

31日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物と1Y物で出会いが見られた。

<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

2024/1/31	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	▲0.087	0.001	▲0.011				-	▲0.082	0.730	+0.025	36,286.71	+220.85	147.33-34	147.65-67
T/N			▲0.007				-	▲0.084						
S/N							-	-						
1W	▲0.019	0.001	▲0.014				-	▲0.091						
2W	▲0.017	▲0.015	▲0.016				-	▲0.097						
3W							-	▲0.102						
1M	▲0.002	0.001	▲0.001				-	▲0.107						
3M	0.020	0.025	0.023				▲0.150	▲0.123						
6M							▲0.170	▲0.093						
1Y							▲0.045	▲0.061						
									日付	1/24	1/25	1/26	1/29	1/30
									日銀当預残	5,366,300	5,393,800	5,393,400	5,406,000	5,434,900
									準備預金残	4,686,300	4,713,200	4,700,600	4,715,800	4,740,900
									マネタリーベース	6,633,000	6,660,100	6,659,300	6,671,300	6,699,500
									無担O/N加重平均	▲0.013%	▲0.012%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%
									コール市場残高	198,971	200,437	197,013	209,290	197,364
									うち無担	170,603	172,360	170,082	179,881	167,843
									うちO/N	74,305	76,187	74,949	88,953	75,870
									うち有担	28,368	28,077	26,931	29,409	29,521

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/31	2024/2/1	▲0.350	36,522	36,522		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/31	2024/2/1	▲0.350	11	11		▲0.350	▲0.350	

●2024年2月1日の予定

*英中銀MPC	*10年利付国債入札(27,000億円、2/2発行)
*1月のISM製造業景況指数	*交付税特別会計借入(12,500億円、2/15借入)
*12月の米建設支出	
*1月のユーロ圏消費者物価指数速報値	

◆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ものがあります。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