

# Central Daily Market Report

2024年1月10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10日 需給速報	2024年1月11日 需給予想	2024年1月12日 当社予想			
銀行券	2,600	2,000	3,000			
財政	▲700	▲35,900	▲12,000			
資金過不足	1,900	▲33,900	▲9,000			
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	8,400	▲12,600				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	9,500					
CP等買入		▲400		▲300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲100				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲35,200	39,700		35,200		
当増減	11,200	1,000		▲9,000		
当座預金残高	5,429,900	5,430,900		5,421,900		
準備預金残高	4,712,300					
積み終了先	4,712,200			1月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,712,100			積数	300	
非準備預金先	717,600			1日平均	100	
積み期間(12/16~1/15)の所要準備額					4,033,600	
準備預金進捗率	実績	99.99%		日数	83.87%	

## ●2024年1月10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▲0.025~▲0.005%近辺での出会いとなった。引き続きビッドサイドからの資金調達ニーズは強く、出会い水準は前日対比で横ばい圏での推移となった。  
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、▲0.16~▲0.10%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>

10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。

## ●短期金融市場関連指標

2024/1/10	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
O/N	▲0.080	0.001	▲0.016					-	▲0.186	0.615	+0.035	34,441.72	+678.54	144.42-44	144.93-95
T/N			▲0.012					-	▲0.146						
S/N								-	-						
1W	▲0.035	0.100	▲0.022					-	▲0.131						
2W	▲0.026	▲0.025	▲0.026					-	▲0.138						
3W								-	▲0.139						
1M	0.015	0.030	0.017					-	▲0.143						
3M	0.008	0.040	0.024					▲0.200	▲0.146						
6M								▲0.177	▲0.100						
1Y								▲0.050	▲0.062						
										日付	12/28	12/29	1/4	1/5	1/9
										日銀当預残	5,440,900	5,436,800	5,438,500	5,445,400	5,418,700
										準備預金残	4,709,100	4,736,100	4,721,600	4,736,300	4,725,100
										マネタリーベース	6,734,900	6,730,500	6,729,900	6,733,600	6,703,800
										無担O/N加重平均	▲0.016%	▲0.039%	▲0.021%	▲0.018%	▲0.017%
										コール市場残高	202,268	139,628	169,134	180,502	184,233
										うち無担	174,810	115,456	142,284	153,847	158,831
										うちO/N	83,923	66,708	73,846	79,899	80,568
										うち有担	27,458	24,172	26,850	26,655	25,402

## ●入札結果

名称	回数	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	素分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	373	0.6%	27,000	2024/1/11	2033/12/20	63,272	21,787	99.91	0.609%	30.3621%	100.03	0.596%	5,193	15.22
交付税特会	-	-	13,000	2024/1/18	2024/7/18	488,085	12,990.19		0.000%	2.6615%		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	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/10	2024/1/11	▲0.350	35,302	35,302		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/10	2024/1/11	▲0.350	0	0				

## ●2024年1月11日の予定

\*日銀支店長会議(さくらレポート)

\*12月のマネタリーベースと日本銀行の取引

\*11月の景気動向指数速報

\*12月の米消費者物価指数

\*12月の米財政収支

◆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