

Central Daily Market Report

2024年1月19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19日 需給速報	2024年1月22日 需給予想	2024年1月23日 当社予想			
銀行券	1,500	1,000	500			
財政	▲ 8,000	▲ 200	▲ 4,000			
資金過不足	▲ 6,500	800	▲ 3,500			
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
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			13,700			
CP等買入		▲ 800	▲ 200			
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			1,000	
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 32,600	32,800	32,600			
*FDR資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 7,300	46,900	▲ 10,900			
当座預金残高	5,362,500	5,409,400	5,398,500			
準備預金残高	4,666,200					
積み終了先	4,661,700			1月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,656,000			積数	32,400	
非準備預金先	696,300			1日平均	1,300	
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	99.20%	日数	19.35%		

●2024年1月19日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.01%程度での出合いが中心となった。引き続き調達ニーズが強い中、週末3日積みとなった事でレート水準は若干上昇した。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、▲0.095~▲0.08%程度での出合いとなった。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>

19日はTB3M物(第1208回)の入札が実施され、やや弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも小甘い推移となった。

<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

2024/1/19	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	0.010	▲ 0.011					-	▲ 0.091	0.665	+0.015	35,963.27	+497.10	148.12-14	148.26-28
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.018	0.001	▲ 0.011					-	▲ 0.105						
2W	▲ 0.027	▲ 0.001	▲ 0.014					-	▲ 0.114						
3W			▲ 0.010					-	▲ 0.118						
1M	▲ 0.023	0.001	▲ 0.014					-	▲ 0.122						
3M			0.035					▲ 0.187	▲ 0.144						
6M								▲ 0.190	▲ 0.094						
1Y								▲ 0.070	▲ 0.059						
									日付	1/12	1/15	1/16	1/17	1/18	
									日銀当預残	5,388,000	5,376,500	5,397,700	5,374,100	5,369,800	
									準備預金残	4,694,000	4,698,000	4,701,200	4,698,100	4,685,300	
									マネタリーベース	6,665,500	6,652,200	6,671,600	6,646,700	6,640,900	
									無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.009%	▲ 0.017%	▲ 0.014%	▲ 0.014%	
									コール市場残高	187,514	186,094	199,180	198,465	202,103	
									うち無担	161,905	159,931	172,111	171,707	176,121	
									うちO/N	79,062	76,338	87,538	83,979	83,843	
									うち有担	25,609	26,163	27,069	26,758	25,982	

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1208	-	56,000	2024/1/22	2024/4/22	126,030	45,471.7	100.0430	▲0.1723%	68.2153%	100.0467	▲0.1872%	10,528

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/1/22			9,673	3,752	▲0.008		▲0.006	19.2
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/1/22			11,785	4,252	▲0.010		▲0.008	90.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/1/22			13,601	4,753	▲0.016		▲0.015	92.4
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/1/22			2,670	754	0.000		0.001	91.9
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/19	2024/1/22	▲0.350	32,283	32,283		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/19	2024/1/22	▲0.350	513	513		▲0.350	▲0.350	

●2024年1月22日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、23日まで)

*流動性供給入札(5,000億円、1/23発行)

◆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