

Central Daily Market Report

2024年1月24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24日 需給速報	2024年1月25日 需給予想	2024年1月26日 当社予想			
銀行券	700	500	▲ 500			
財政	▲ 8,000	16,700	▲ 8,000			
資金過不足	▲ 7,300	17,200	▲ 8,500			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入			14,100			
CP等買入						
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	▲ 100			
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 36,100	34,600	36,100			
当預増減	▲ 8,900	68,300	▲ 8,500			
当座預金残高	5,366,300	5,434,600	5,426,100			
準備預金残高	4,686,100					
積み終了先	4,683,700			1月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,683,700			積数	22,000	
非準備預金先	680,200			1日平均	1,000	
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	99.46%	日数	29.03%		

●2024年1月24日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.013~▲0.010%程度での出会いが中心となった。引き続きビッド件数は多く、調達ニーズは底堅い展開が継続している。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、▲0.080~▲0.070%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>

24日は、昨年12月26日以来となる短国買入オペがオファーされた。買入金額は前回と同額の1,000億円であったが、弱い結果となった。また、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発行市場は複数の業態で大型発行が実施された。発行レートは、概ね幅ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2024/1/24	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京	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	レポレート	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.085	0.001	▲ 0.013				-	▲ 0.076	0.715	+0.080	36,226.48	▲ 291.09	148.24~26	147.78~80
T/N			▲ 0.010				-	▲ 0.076						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.027	0.001	▲ 0.015				-	▲ 0.089						
2W	▲ 0.023	0.030	▲ 0.015				-	▲ 0.102						
3W			0.005				-	▲ 0.109						
1M			0.001				-	▲ 0.113						
3M	0.035	0.040	0.037				▲ 0.180	▲ 0.132						
6M							▲ 0.190	▲ 0.097						
1Y							▲ 0.090	▲ 0.061						
日付	1/17	1/18	1/19	1/22	1/23									
日銀当預残	5,374,100	5,369,800	5,362,500	5,377,200	5,375,200									
準備預金残	4,698,100	4,685,300	4,666,300	4,685,000	4,690,700									
マネタリーベース	6,646,700	6,640,900	6,632,000	6,645,900	6,642,700									
無担O/N加重平均	▲ 0.014%	▲ 0.014%	▲ 0.011%	▲ 0.014%	▲ 0.014%									
コール市場残高	198,465	202,103	201,765	203,969	192,509									
うち無担	171,707	176,121	176,955	175,536	165,747									
うちO/N	83,979	83,843	80,547	78,678	69,159									
うち有担	26,758	25,982	24,810	28,433	26,762									

●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非償格競争入札(億円)	非償格入札(億円)
交付税特会	-	-	13,000	2024/1/31	2024/7/31	446,270	12,990.22		0.000%	2.9109%		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	2024/1/25			6,593	1,000	0.042		0.048	66.7
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/1/25			9,537	3,754	0.032		0.035	9.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/1/25			13,374	4,252	0.067		0.068	95.6
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/1/25			13,906	4,754	0.080		0.082	78.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/1/25			4,736	1,500	0.105		0.108	87.1
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/1/24	2024/1/25	▲ 0.350	36,139	36,139		▲ 0.350	▲ 0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/24	2024/1/25	▲ 0.350	90	90		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2024年1月25日の予定

*月例経済報告	*ECB定例理事会(金融政策発表)	*40年利付国債入札(7,000億円、1/26発行)
	*10-12月期の米GDP速報値	
	*12月の米新築一戸建て販売件数	
	*12月の米耐久財新規受注	

◆本資料は信頼できると思わ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論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