

# Central Daily Market Report

2024年1月25日(木)

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25日 需給速報	2024年1月26日 需給予想	2024年1月29日 当社予想				
銀行券	500	400	2,000				
財政	13,200	300	13,000				
資金過不足	13,700	700	15,000				
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	14,100						
CP等買入				▲400			
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		▲200			
気候変動対応オペ							
ETF買入							
国債補充供給	▲37,300	36,100		37,300			
*FDR資金供給用担保提供情報							
当増減	27,500		37,400		15,000		
当座預金残高	5,393,800		5,431,200		5,446,200		
準備預金残高	4,712,700						
積み終了先	4,710,400					1月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,710,400					積数	19,800
非準備預金先	681,100					1日平均	900
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	99.51%	日数	32.26%			

## ●2024年1月25日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、▲0.011~▲0.010%程度での出会いが中心となった。相場に大きな変化はなく、引き続き調達ニーズが強いなか、レート水準は前日比で概ね横這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、▲0.080~▲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>

25日のアウトライ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

2024/1/25	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	▲0.080	0.001	▲0.012				-	▲0.077	0.745	+0.030	36,236.47	+9.99	147.58-60	147.67-69
T/N	▲0.015	▲0.008	▲0.008				-	▲0.080						
S/N							-	-						
1W	▲0.020	▲0.010	▲0.014				-	▲0.089						
2W							-	▲0.100						
3W							-	▲0.108						
1M	0.005	0.350	0.024				-	▲0.113						
3M			0.030				▲0.160	▲0.133						
6M							▲0.170	▲0.095						
1Y							▲0.070	▲0.061						
									日付	1/18	1/19	1/22	1/23	1/24
									日銀当預残	5,369,800	5,362,500	5,377,200	5,375,200	5,366,300
									準備預金残	4,685,300	4,666,300	4,685,000	4,690,700	4,686,300
									マネタリーベース	6,640,900	6,632,000	6,645,900	6,642,700	6,633,000
									無担O/N加重平均	▲0.014%	▲0.011%	▲0.014%	▲0.014%	▲0.013%
									コール市場残高	202,103	201,765	203,969	192,509	198,971
									うち無担	176,121	176,955	175,536	165,747	170,603
									うちO/N	83,843	80,547	78,678	69,159	74,305
									うち有担	25,982	24,810	28,433	26,762	28,368

## ●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第I非価格競争入札(億円)
40年利付国債	16	1.3%	7,000	2024/1/26	2063/3/20	15,025	6,995	82.87	1.925%	46.7391%			

## ●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・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)		2024/1/25	2024/1/26	▲0.350	37,676	37,676		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/1/25	2024/1/26	▲0.350	5	5		▲0.350	▲0.350	

## ●2024年1月26日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(12月18・19日分)	*12月の米個人所得・消費支出(PCE)	*国庫短期証券(1209回)入札(3ヶ月、56,000億円、1/29発行)
*1月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+1.9%)		*交付税特別会計借入(12,500億円、2/5借入)
*12月の企業向けサービス価格指数		
*11月の景気動向指数改訂状況		

◆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