

Central Daily Market Report

2024年2月1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2月1日 需給速報	2024年2月2日 需給予想	2024年2月5日 当社予想			
銀行券	300	800	100			
財政	▲ 36,200	▲ 101,400	1,000			
資金過不足	▲ 35,900	▲ 100,600	1,100			
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						
国債買入						
CP等買入				▲ 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						
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 34,300	36,200		34,300		
*ドル資金供給用担保提供開始						
当増減	▲ 34,000	▲ 66,600				1,100
当座預金残高	5,402,900	5,336,300				5,337,400
準備預金残高	4,720,400					
積み終了先	4,719,300				2月2日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,719,300				積数	7,300
非準備預金先	682,500				1日平均	500
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	99.82%		日数		54.84%

●2024年2月1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▲0.009~▲0.006%近辺の出会いが始まった。月末要因剥落により、調達を再開する先も見られ、取り上がる動きが広がったことで出会いの水準も僅かに上昇した。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、▲0.08~▲0.07%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>

1日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部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

2024/2/1	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	▲ 0.010					-	▲ 0.080	0.690	▲ 0.040	36,011.46	▲ 275.25	147.00-02	146.80-82
T/N			▲ 0.005					-	▲ 0.080						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.008	▲ 0.025					-	▲ 0.088						
2W			▲ 0.016					-	▲ 0.094						
3W								-	▲ 0.100						
1M	▲ 0.001	0.015	0.010					-	▲ 0.105						
3M			0.030					▲ 0.150	▲ 0.125						
6M								▲ 0.170	▲ 0.093						
1Y								▲ 0.045	▲ 0.060						
										日付	1/25	1/26	1/29	1/30	1/31
										日銀当預残	5,393,800	5,393,400	5,406,000	5,434,900	5,436,900
										準備預金残	4,713,200	4,700,600	4,715,800	4,740,900	4,728,000
										マネタリーベース	6,660,100	6,659,300	6,671,300	6,699,500	6,700,800
										無担O/N加重平均	▲ 0.012%	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.011%	▲ 0.011%
										コール市場残高	200,437	197,013	209,290	197,364	178,976
										うち無担	172,360	170,082	179,881	167,843	149,610
										うちO/N	76,187	74,949	88,953	75,870	72,192
										うち有担	28,077	26,931	29,409	29,521	29,366

●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	373	0.6%	27,000	2024/2/2	2033/12/20	79,475	21,786	98.63	0.748%	5.1592%	98.70	0.741%	5,203	2.82
交付税特会	-	-	12,500	2024/2/15	2024/8/15	442,674	12,490.4		0.000%	2.8216%		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・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)		2024/2/1	2024/2/2	▲0.350	34,604	34,604		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/1	2024/2/2	▲0.350	0	0				

●2024年2月2日の予定

*1月のマネタリーベース	*1月の米雇用統計	*国庫短期証券(1210回)入札
*財政資金対民間収支前月実績/当月見込み	*12月の米製造業新規受注・出荷・在庫	(3ヶ月、56,000億円、2/5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