

Central Daily Market Report

2024年2月8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8日 需給速報	2024年2月9日 需給予想	2024年2月13日 当社予想			
銀行券	500	700	1,000			
財政	▲ 11,800	5,100	▲ 27,000			
資金過不足	▲ 11,300	5,800	▲ 26,000			
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						
国債買入			14,300			
CP等買入		▲ 100	▲ 100			
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	▲ 31,600	33,300	31,600			
* FDL資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 9,700		51,600			▲ 26,000
当座預金残高	5,336,000		5,387,600			5,361,600
準備預金残高	4,661,300					
積み終了先	4,660,800				2月9日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,660,800				積数	1,400
非準備預金先	674,700				1日平均	200
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額						4,044,000
準備預金進捗率	実績	99.97%			日数	77.42%

●2024年2月8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▲0.005~▲0.002%近辺の出会いが始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。
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、▲0.095~▲0.075%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>

8日はTB6M物(第1211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は、無難に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は案件が乏しく、閑散としたマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。
また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート+0.007%、平均落札レート+0.019%、と前回(按分+0.003%・平均0.012%)比で按分、平均ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2024/2/8	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	売買参考指標	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	▲ 0.005					-	▲ 0.076	0.695	▲ 0.009	36,863.28	+743.36	148.08-10	148.71-73
T/N			▲ 0.001					-	▲ 0.074						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	▲ 0.007	▲ 0.027					-	▲ 0.081						
2W			▲ 0.002					-	▲ 0.089						
3W								-	▲ 0.095						
1M	0.000	0.255	0.088					-	▲ 0.101						
3M								▲ 0.140	▲ 0.118						
6M								▲ 0.104	▲ 0.087						
1Y								▲ 0.045	▲ 0.050						
										日付	2/1	2/2	2/5	2/6	2/7
										日銀当預残	5,402,900	5,302,800	5,363,500	5,340,800	5,345,700
										準備預金残	4,720,400	4,624,700	4,679,700	4,662,000	4,671,400
										マネタリーベース	6,666,500	6,565,500	6,625,300	6,601,800	6,606,400
										無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.008%	▲ 0.008%	▲ 0.007%	▲ 0.006%
										コール市場残高	186,512	187,308	186,712	201,006	200,441
										うち無担	156,433	155,371	157,008	172,062	170,703
										うちO/N	73,675	72,573	73,060	84,094	83,885
										うち有担	30,079	31,937	29,704	28,944	29,738

●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)
国庫短期証券	1211	-	40,000	2024/2/13	2024/8/13	111,697	32,878.7	100.044	▲ 0.0882%	58.5829%	100.052	▲ 0.1042%	7,121
エネルギー対策	-	-	6,500	2024/2/20	2025/2/20	35,300	6,500		0.000%	92.8573%		0.000%	

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/2/9			6,909	3,755	0.000		0.002	41.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/2/9			8,347	4,255	0.002		0.003	89.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/2/9			10,680	4,758	▲ 0.005		▲ 0.004	77.2
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/2/9			3,781	1,509	▲ 0.005		0.003	38.7
CP等買入	4,000	2024/2/14			9,422	3,999	0.007		0.019	90.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/8	2024/2/9	▲ 0.350	31,869	31,869		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/8	2024/2/9	▲ 0.350	0	0				

●2024年2月9日の予定

*1月のマネーストック *12月の特定サービス産業動態統計速報	*国庫短期証券(1212回)入札 (3ヶ月、58,000億円、2/13発行)	*5年利付国債入札 (25,000億円、2/13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自身でなされたいと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