

Central Daily Market Report

2024年2月9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2月9日 需給速報	2024年2月13日 需給予想	2024年2月14日 当社予想	
銀行券	800	300	1,000	
財政	4,500	▲26,900	2,000	
資金過不足	5,300	▲26,600	3,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出				
全店共通				
国債買現		29,800		
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入	14,300			
CP等買入		▲500	4,000	
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	▲33,400	31,600	33,400	
当増減	17,700	36,100	7,000	
当座預金残高	5,353,700	5,389,800	5,396,800	
準備預金残高	4,673,100			
積み終了先	4,672,900			
超過準備	4,672,700			
非準備預金先	680,600			
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	100.00%	日数	90.32%

●2024年2月9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▲0.002~▲0.001%近辺の出合いが始まった。引き続き調達サイドのニーズが強いなか、週末4日積み要因も重なったことで出合いの水準は上昇した。ターム物は目立った出合いなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.06%程度での出合いとなった。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>

9日はTB3M物(第1212回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、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、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

2024/2/9	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	▲0.086	0.001	▲0.005				-	▲0.074	0.720	+0.025	36,897.42	+34.14	149.26-28	149.39-40
T/N			▲0.002				-	▲0.053						
S/N							-	-						
1W	▲0.015	▲0.009	▲0.012				-	▲0.075						
2W							-	▲0.083						
3W	0.030	0.050	0.040				-	▲0.088						
1M							-	▲0.096						
3M							▲0.120	▲0.112						
6M							▲0.104	▲0.082						
1Y							▲0.045	▲0.048						
日付	2/2	2/5	2/6	2/7	2/8									
日銀当預残	5,302,800	5,363,500	5,340,800	5,345,700	5,336,000									
準備預金残	4,624,700	4,679,700	4,662,000	4,671,400	4,661,300									
マネタリーベース	6,565,500	6,625,300	6,601,800	6,606,400	6,596,200									
無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.008%	▲0.007%	▲0.006%	▲0.005%									
コール市場残高	187,308	186,712	201,006	200,441	198,327									
うち無担	155,371	157,008	172,062	170,703	168,831									
うちO/N	72,573	73,060	84,094	83,885	85,773									
うち有担	31,937	29,704	28,944	29,738	29,496									

●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非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1212	-	58,000	2024/2/13	2024/5/20	132,726.9	47,163.6	100.0295	▲0.1109%	11.0529%	100.0325	▲0.1222%	10,836	
5年利付国債	165	0.3%	25,000	2024/2/13	2028/12/20	69,437	20,213	99.92	0.316%	58.1773%	99.95	0.310%	4,769	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)		2024/2/9	2024/2/13	▲0.350	33,656	33,656		▲0.350	▲0.350	
国債買現先	30,000	2024/2/13	2024/2/14		36,350	30,005	▲0.100		▲0.096	74.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/9	2024/2/13	▲0.350	0	0				

●2024年2月12日の予定

*振替休日	*1月の米財政収支
-------	-----------

●2024年2月13日の予定

*1月の企業物価指数	*1月の米消費者物価指数
------------	--------------

◆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