

Central Daily Market Report

2024年2月13日(火)

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13日 需給速報	2024年2月14日 需給予想	2024年2月15日 当社予想			
銀行券	200	200	500			
財政	▲ 32,100	▲ 1,900	69,000			
資金過不足	▲ 31,900	▲ 1,700	69,500			
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	29,800		▲ 29,800			
国債売現						
国庫短期証買入		1,000				
国債買入						
CP等買入		▲ 500	4,000	▲ 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	▲ 35,800	33,400	35,800			
*FDR資金供給用担保提供枠						
当増減	▲ 5,000		9,200			69,500
当座預金残高	5,348,700		5,357,900			5,427,400
準備預金残高	4,675,500					
積み終了先	4,675,500				2月14日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,675,400				積数	0
非準備預金先	673,200				1日平均	0
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			93.55%

●2024年2月13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▲0.003~▲0.002%近辺で出合いが見られた。週末4日積み要因が剥落した事で、レート水準は前営業日比で若干低下したものの、引き続き高水準での推移となっている。ターム物は目立った出合いがなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.045%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>

13日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円度でオファーされ、弱めの結果となった。マーケットでは3M物に少額の出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。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

2024/2/13	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	売買参考水準	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					-	▲ 0.070	0.725	+0.005	37,963.97	+1066.55	149.40-42	149.58-59
T/N			▲ 0.003					-	▲ 0.062						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.001					-	▲ 0.072						
2W			▲ 0.002					-	▲ 0.080						
3W								-	▲ 0.086						
1M								-	▲ 0.091						
3M				0.030				▲ 0.115	▲ 0.104						
6M								▲ 0.104	▲ 0.079						
1Y								▲ 0.045	▲ 0.045						
										日付	2/5	2/6	2/7	2/8	2/9
										日銀当預残	5,363,500	5,340,800	5,345,700	5,336,000	5,353,700
										準備預金残	4,679,700	4,662,000	4,671,400	4,661,300	4,673,800
										マネタリーベース	6,625,300	6,601,800	6,606,400	6,596,200	6,613,100
										無担O/N加重平均	▲0.008%	▲0.007%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.005%
										コール市場残高	186,712	201,006	200,441	198,327	184,279
										うち無担	157,008	172,062	170,703	168,831	154,154
										うちO/N	73,060	84,094	83,885	85,773	77,806
										うち有担	29,704	28,944	29,738	29,496	30,125

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国庫短期証券買入	1,000	2024/2/14			5,831	1,000	0.023		0.024	33.0
米ドル資金供給		2024/2/15	2024/2/22	5.580	1	1				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/13	2024/2/14	▲0.350	36,158	36,158		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/13	2024/2/14	▲0.350	0	0				

●2024年2月14日の予定

*10-12月期のユーロ圏GDP2次速報	*GX10年利付国債入札(8,000億円、2/15発行)	*国有林野借入(872億円、2/26借入)
*1月の英消費者物価指数		

◆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ものがあります。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