

Central Daily Market Report

2024年2月14日(水)

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14日 需給速報	2024年2月15日 需給予想	2024年2月16日 当社予想				
銀行券	500	0	▲ 500				
財政	▲ 4,200	67,700	▲ 3,000				
資金過不足	▲ 3,700	67,700	▲ 3,500				
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	24,400			▲ 56,100	
国債売現							
国庫短期証買入	1,000						
国債買入							
CP等買入	4,000	▲ 100		▲ 700			
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)				▲ 300			
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	▲ 31,900	35,800		31,900			
*F/L資金供給用担保提供額							
当預増減	▲ 24,700		123,000		▲ 59,600		
当座預金残高	5,324,000		5,447,000		5,387,400		
準備預金残高	4,654,200						
積み終了先	4,654,200					2月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,654,100					積数	0
非準備預金先	669,800					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	96.77%		

●2024年2月14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%近辺の出会いが見られた。積み期終盤のため、マクロ加算残高に余裕がある先からの調達が見られ、レートは前日比横ばい高止まりで推移した。ターム物は新積み期スタートのショートタームで引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.07~▲0.02%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>

14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、数件の入札が実施された。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

2024/2/14	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	▲ 0.075	0.001	▲ 0.005					-	▲ 0.059	0.755	+0.030	37,703.32	▲ 260.65	150.72-73	150.44-46
T/N			▲ 0.002					-	▲ 0.062						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.004					-	▲ 0.070						
2W			▲ 0.010					-	▲ 0.079						
3W			0.010					-	▲ 0.085						
1M	▲ 0.001	0.200	0.086					-	▲ 0.089						
3M			0.050					▲ 0.115	▲ 0.098						
6M								▲ 0.104	▲ 0.073						
1Y								▲ 0.045	▲ 0.043						
									日付	2/6	2/7	2/8	2/9	2/13	
									日銀当預残	5,340,800	5,345,700	5,336,000	5,353,700	5,348,700	
									準備預金残	4,662,000	4,671,400	4,661,300	4,673,800	4,676,300	
									マネタリーベース	6,601,800	6,606,400	6,596,200	6,613,100	6,607,900	
									無担O/N加重平均	▲ 0.007%	▲ 0.006%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	
									コール市場残高	201,006	200,441	198,327	184,279	186,094	
									うち無担	172,062	170,703	168,831	154,154	156,667	
									うちO/N	84,094	83,885	85,773	77,806	74,719	
									うち有担	28,944	29,738	29,496	30,125	29,427	

●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)
GX10年利付国債	1	0.7%	8,000	2024/2/15	2033/12/20	23,212	7,995	99.62	0.740%	67.7966%			
国有林野借入	-	-	872	2024/2/26	2029/2/25	3,367	872		0.331%	57.7982%		0.299%	

●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*	応募総額(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
国債買現先	25,000	2024/2/15	2024/2/16		36,750	25,003	▲ 0.100		▲ 0.090	5.3
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/14	2024/2/15	▲ 0.350	32,235	32,235		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/14	2024/2/15	▲ 0.350	0	0				

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)
被災地金融支援オペ	第23回	2024/2/16	2026/2/16	0

●2024年2月15日の予定

*10-12月期のGDP 1次速報 (市場予想: 前期比年率1.4%)	*12月の米企業在庫 *1月の米小売売上高 *1月の米鉱工業生産・設備稼働率	*10-12月期の英GDP速報値
--	--	------------------

◆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