

Central Daily Market Report

2024年2月15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15日 需給速報	2024年2月16日 需給予想	2024年2月19日 当社予想			
銀行券	▲ 100	0	▲ 500			
財政	65,900	2,800	▲ 6,000			
資金過不足	65,800	2,800	▲ 6,500			
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	24,400		▲ 54,000			
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,300			
CP等買入		▲ 700	▲ 200			
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	▲ 35,200	31,900	35,200			
*FDR資金供給用担保提供額						
当預増減	85,900	▲ 5,900	▲ 6,500			
当座預金残高	5,409,900	5,404,000	5,397,500			
準備預金残高	4,740,500					
積み終了先	4,740,500			2月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,740,500			積数	3,772,800	
非準備預金先	669,400			1日平均	130,100	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					3,772,800	
準備預金進捗率	実績	0.00%	日数	0.00%		

●2024年2月15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~▲0.001%近辺で出合いが見られた。積み最終日となったが、依然としてマクロ加算残高に余裕がある先からの調達が多く見られたため、レートは前日比横ばい圏での推移となった。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、▲0.085~▲0.080%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>

15日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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

2024/2/15	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	▲ 0.070	0.001	▲ 0.005					-	▲ 0.075	0.725	▲ 0.030	38,157.94	+454.62	150.55-56	150.20-21
T/N			▲ 0.003					-	▲ 0.083						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.015	0.001	▲ 0.005					-	▲ 0.083						
2W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.009					-	▲ 0.087						
3W			▲ 0.003					-	▲ 0.089						
1M	▲ 0.015	0.015	0.005					-	▲ 0.094						
3M			0.030					▲ 0.115	▲ 0.097						
6M								▲ 0.104	▲ 0.073						
1Y								▲ 0.045	▲ 0.043						
										日付	2/7	2/8	2/9	2/13	2/14
										日銀当預残	5,345,700	5,336,000	5,353,700	5,348,700	5,324,000
										準備預金残	4,671,400	4,661,300	4,673,800	4,676,300	4,654,400
										マネタリーベース	6,606,400	6,596,200	6,613,100	6,607,900	6,582,800
										無担O/N加重平均	▲ 0.006%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%
										コール市場残高	200,441	198,327	184,279	186,094	176,910
										うち無担	170,703	168,831	154,154	156,667	148,433
										うちO/N	83,885	85,773	77,806	74,719	67,285
										うち有担	29,738	29,496	30,125	29,427	28,477

●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/2/16			9,773	3,754	▲0.009		▲0.006	49.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/2/16			11,842	4,256	▲0.030		▲0.028	11.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/2/16			3,470	1,503	▲0.026		▲0.024	93.0
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/2/16			2,581	755	▲0.016		▲0.012	4.6
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/15	2024/2/16	▲0.350	35,585	35,585		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/15	2024/2/16	▲0.350	0	0				

●2024年2月16日の予定

*12月の第3次産業活動指数	*1月の米生産者物価指数	*国庫短期証券(1213回)入札(3ヶ月、58,000億円、2/19発行)
*12月の石油等消費動態統計	*1月の米住宅着工件数	*流動性供給入札(5,000億円、2/19発行)
	*2月のミシガン大消費者信頼感指数速報	

◆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