

# Central Daily Market Report

2024年2月21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21日 需給速報	2024年2月22日 需給予想	2024年2月26日 当社予想			
銀行券	▲ 400	▲ 1,000	▲ 500			
財政	▲ 20,800	22,800	▲ 5,000			
資金過不足	▲ 21,200	21,800	▲ 5,500			
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	7,100	▲ 7,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入	1,000					
国債買入			12,800			
CP等買入		▲ 500	▲ 700			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入	1,000		▲ 200			
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 33,100	35,000	33,100			
当増増減	▲ 18,200	66,800	▲ 5,500			
当座預金残高	5,342,100	5,408,900	5,403,400			
準備預金残高	4,664,000					
積み終了先	4,659,800			2月22日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,658,800			積数	26,700	
非準備預金先	678,100			1日平均	1,200	
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	99.29%	日数	20.69%		

## ●2024年2月21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▲0.004~▲0.003%近辺で出合いが見られた。引き続き地銀業態を中心に調達ニーズが強く、レート水準は横ばい圏での推移となった。  
ターム物は、ショートタームを中心にビッドが集まるものの、オファーが少なく閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.10%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>

21日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物で出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、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

2024/2/21	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.095	0.720	▲ 0.009	38,262.16	▲ 101.45	149.96-97	150.14-16
T/N			▲ 0.002					-	▲ 0.105						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.040	0.001	▲ 0.017					-	▲ 0.102						
2W	▲ 0.003	0.000	▲ 0.002					-	▲ 0.104						
3W			0.040					-	▲ 0.105						
1M								-	▲ 0.108						
3M			0.030					▲ 0.135	▲ 0.073						
6M								▲ 0.104	▲ 0.051						
1Y								0.025	0.008						
										日付	2/14	2/15	2/16	2/19	2/20
										日銀当預残	5,324,000	5,409,900	5,367,200	5,363,800	5,360,300
										準備預金残	4,654,400	4,741,100	4,698,100	4,688,400	4,685,500
										マネタリーベース	6,582,800	6,668,700	6,626,100	6,622,300	6,619,300
										無担O/N加重平均	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.006%
										コール市場残高	176,910	179,102	213,979	202,584	209,040
										うち無担	148,433	150,598	183,869	173,424	178,939
										うちO/N	67,285	69,280	92,211	82,866	86,216
										うち有担	28,477	28,504	30,110	29,160	30,101

## ●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	2024/2/22			12,110	3,756	0.002		0.004	21.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/2/22			10,823	4,260	0.004		0.005	74.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/2/22			7,104	4,754	▲ 0.003		0.001	2.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/21	2024/2/22	▲ 0.350	33,445	33,445		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/21	2024/2/22	▲ 0.350	0	0				

## ●2024年2月22日の予定

*1月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1215回)入札(3ヶ月、58,000億円、2/26発行)
*1月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*流動性供給入札(5,000億円、2/26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