

# Central Daily Market Report

2024年2月22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22日<br>需給速報 | 2024年2月26日<br>需給予想 | 2024年2月27日<br>当社予想 |           |                 |           |
|-----------------------|--------------------|--------------------|--------------------|-----------|-----------------|-----------|
| 銀行券                   | ▲ 1,000            | 300                | ▲ 500              |           |                 |           |
| 財政                    | 20,300             | ▲ 2,700            | 2,000              |           |                 |           |
| 資金過不足                 | 19,300             | ▲ 2,400            | 1,500              |           |                 |           |
| 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                  |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 国債売現                  |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 国庫短期証買入               |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 国債買入                  | 12,800             |                    |                    |           |                 |           |
| CP等買入                 |                    | ▲ 700              |                    | ▲ 300     |                 |           |
| 貸出支援基金(成)             |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 貸出支援基金(貸)             |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 被災地支援                 |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 社債等買入                 |                    | ▲ 200              |                    |           |                 |           |
| 気候変動対応オペ              |                    |                    |                    |           |                 |           |
| E T F買入               |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 国債補充供給                | ▲ 34,100           | 33,100             |                    | 34,100    |                 |           |
| *FDR資金供給用担保提供枠        |                    |                    |                    |           |                 |           |
| 当預増減                  | 30,200             | 31,400             |                    | 1,500     |                 |           |
| 当座預金残高                | 5,372,300          | 5,403,700          |                    | 5,405,200 |                 |           |
| 準備預金残高                | 4,683,900          |                    |                    |           |                 |           |
| 積み終了先                 | 4,681,600          |                    |                    |           | 2月26日以降の残り所要積立額 |           |
| 超過準備                  | 4,681,200          |                    |                    |           | 積数              | 15,700    |
| 非準備預金先                | 688,400            |                    |                    |           | 1日平均            | 800       |
| 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                 | 99.58%             |                    | 日数        |                 | 34.48%    |

## ●2024年2月22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~▲0.002%近辺で出会いが見られた。連休前の4日積みとなったため、地銀業態を中心に調達意欲が一段と強まった結果、レート水準は若干上昇する展開となった。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~▲0.085%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>

22日はTB3M物(第1215回)の入札が実施され、弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、軟調に推移した。

### <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

| 2024/2/22 | 無担(速報) |       |        | 有担(速報) |    |    | 短国 | 東京<br>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       | ▲0.087 | 0.001 | ▲0.005 |        |    |    |    | -           | ▲0.097    | 0.715     | ▲0.005    | 39,098.68 | +836.52   | 150.34-35 | 150.12-14 |
| T/N       |        |       | ▲0.002 |        |    |    |    | -           | ▲0.105    |           |           |           |           |           |           |
| S/N       |        |       | ▲0.002 |        |    |    |    | -           | -         |           |           |           |           |           |           |
| 1W        |        |       | ▲0.007 |        |    |    |    | -           | ▲0.103    |           |           |           |           |           |           |
| 2W        |        |       | ▲0.002 |        |    |    |    | -           | ▲0.104    |           |           |           |           |           |           |
| 3W        |        |       |        |        |    |    |    | -           | ▲0.108    |           |           |           |           |           |           |
| 1M        |        |       | 0.005  |        |    |    |    | -           | ▲0.110    |           |           |           |           |           |           |
| 3M        |        |       | 0.028  |        |    |    |    | ▲0.099      | ▲0.071    |           |           |           |           |           |           |
| 6M        |        |       |        |        |    |    |    | ▲0.080      | ▲0.047    |           |           |           |           |           |           |
| 1Y        |        |       |        |        |    |    |    | 0.025       | 0.008     |           |           |           |           |           |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | 日付        | 2/15      | 2/16      | 2/19      | 2/20      | 2/21      |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | 日銀当預残     | 5,409,900 | 5,367,200 | 5,363,800 | 5,360,300 | 5,342,100 |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | 準備預金残     | 4,741,100 | 4,698,100 | 4,688,400 | 4,685,500 | 4,664,100 |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | マネタリーベース  | 6,668,700 | 6,626,100 | 6,622,300 | 6,619,300 | 6,601,500 |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | 無担O/N加重平均 | ▲0.005%   | ▲0.006%   | ▲0.006%   | ▲0.006%   | ▲0.006%   |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | コール市場残高   | 179,102   | 213,979   | 202,584   | 209,040   | 206,400   |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | うち無担      | 150,598   | 183,869   | 173,424   | 178,939   | 175,540   |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | うちO/N     | 69,280    | 92,211    | 82,866    | 86,216    | 83,777    |           |
|           |        |       |        |        |    |    |    |             | うち有担      | 28,504    | 30,110    | 29,160    | 30,101    | 30,860    |           |

## ●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I非価格競争入札(億円) |
|--------|------|------|--------|-----------|----------|---------|----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 国庫短期証券 | 1215 | -    | 58,000 | 2024/2/26 | 2024/6/3 | 106,688 | 46,931.7 | 100.0265 | ▲0.0986%    | 68.4150% | 100.0301 | ▲0.1120%    | 11,068        |
| 流動性供給  | 400  | -    | 5,000  | 2024/2/26 | -        | 22,330  | 4,989    |          | ▲0.015%     | 78.3699% |          | ▲0.015%     |               |

## ●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) |                | 2024/2/22 | 2024/2/26 | ▲0.350 | 34,359        | 34,359        |                 | ▲0.350          | ▲0.350            |      |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) |                | 2024/2/22 | 2024/2/26 | ▲0.350 | 47            | 47            |                 | ▲0.350          | ▲0.350            |      |

## ●2024年2月26日の予定

|                  |                 |
|------------------|-----------------|
| *1月の企業向けサービス価格指数 | *1月の米新築一戸建て販売件数 |
|------------------|-----------------|

◆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