

# Central Daily Market Report

2024年2月26日(月)

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26日<br>需給速報 | 2024年2月27日<br>需給予想 | 2024年2月28日<br>当社予想 |        |                 |           |
|-----------------------|--------------------|--------------------|--------------------|--------|-----------------|-----------|
| 銀行券                   | 200                | ▲ 200              | ▲ 500              |        |                 |           |
| 財政                    | ▲ 3,200            | 1,800              | 4,000              |        |                 |           |
| 資金過不足                 | ▲ 3,000            | 1,600              | 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                  |                    |                    |                    |        |                 |           |
| 国債売現                  |                    |                    |                    |        |                 |           |
| 国庫短期証買入               |                    |                    |                    |        |                 |           |
| 国債買入                  |                    |                    |                    |        |                 |           |
| CP等買入                 |                    | ▲ 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                 |                    |                    |                    |        |                 |           |
| 気候変動対応オペ              |                    |                    |                    |        |                 |           |
| ETF買入                 |                    |                    |                    |        |                 |           |
| 国債補充供給                | ▲ 33,500           | 34,100             |                    | 33,500 |                 |           |
| *F/L資金供給用担保提供額        |                    |                    |                    |        |                 |           |
| 当増減                   | ▲ 2,700            |                    | 35,100             |        |                 | 3,500     |
| 当座預金残高                | 5,369,600          |                    | 5,404,700          |        |                 | 5,408,200 |
| 準備預金残高                | 4,684,600          |                    |                    |        |                 |           |
| 積み終了先                 | 4,683,400          |                    |                    |        | 2月27日以降の残り所要積立額 |           |
| 超過準備                  | 4,682,500          |                    |                    |        | 積数              | 13,500    |
| 非準備預金先                | 685,000            |                    |                    |        | 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                 | 99.64%             |                    | 日数     |                 | 37.93%    |

## ●2024年2月26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▲0.005~▲0.002%近辺で出合いが見られた。週末要因は剥落したものの、引き続き邦銀業態を中心に調達ニーズの強い展開となっており、レートは概ね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、▲0.10~▲0.09%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>

26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、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。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でおファーされた。結果は、按分レート+0.011%、平均落札レート+0.030%と、前回(按分+0.007%・平均+0.019%)比で按分、平均ともに上昇した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2024/2/26 | 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 | ▲ 0.006 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.092   | 0.685     | ▲ 0.030   | 39,233.71 | +135.03   | 150.49-50 | 150.46-47 |
| T/N       |         |       | ▲ 0.002 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.100   |           |           |           |           |           |           |
| S/N       |         |       | 0.001   |        |    |    |    | -           | -         |           |           |           |           |           |           |
| 1W        | ▲ 0.010 | 0.001 | ▲ 0.001 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.098   |           |           |           |           |           |           |
| 2W        |         |       | ▲ 0.001 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.101   |           |           |           |           |           |           |
| 3W        |         |       |         |        |    |    |    | -           | ▲ 0.104   |           |           |           |           |           |           |
| 1M        |         |       | ▲ 0.002 |        |    |    |    | -           | ▲ 0.105   |           |           |           |           |           |           |
| 3M        | 0.028   | 0.100 | 0.064   |        |    |    |    | ▲ 0.099     | ▲ 0.066   |           |           |           |           |           |           |
| 6M        |         |       |         |        |    |    |    | ▲ 0.070     | ▲ 0.041   |           |           |           |           |           |           |
| 1Y        |         |       |         |        |    |    |    | 0.025       | 0.010     |           |           |           |           |           |           |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | 日付        | 2/16      | 2/19      | 2/20      | 2/21      | 2/22      |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | 日銀当預残     | 5,367,200 | 5,363,800 | 5,360,300 | 5,342,100 | 5,372,300 |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | 準備預金残     | 4,698,100 | 4,688,400 | 4,685,500 | 4,664,100 | 4,684,700 |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | マネタリーベース  | 6,626,100 | 6,622,300 | 6,619,300 | 6,601,500 | 6,632,600 |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | 無担O/N加重平均 | ▲ 0.006%  | ▲ 0.006%  | ▲ 0.006%  | ▲ 0.006%  | ▲ 0.005%  |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | コール市場残高   | 213,979   | 202,584   | 209,040   | 206,400   | 209,778   |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | うち無担      | 183,869   | 173,424   | 178,939   | 175,540   | 178,847   |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | うちO/N     | 92,211    | 82,866    | 86,216    | 83,777    | 93,464    |
|           |         |       |         |        |    |    |    |             |           | うち有担      | 30,110    | 29,160    | 30,101    | 30,860    | 30,931    |

## ●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 |
|---------------------------|----------------|-----------|-----------|---------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| CP等買入                     | 4,000          | 2024/2/29 |           |         | 8,268         | 3,990         | 0.011           |                 | 0.030             | 19.5 |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) |                | 2024/2/26 | 2024/2/27 | ▲ 0.350 | 33,726        | 33,726        |                 | ▲ 0.350         | ▲ 0.350           |      |
| 国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) |                | 2024/2/26 | 2024/2/27 | ▲ 0.350 | 133           | 133           |                 | ▲ 0.350         | ▲ 0.350           |      |

## ●2024年2月27日の予定

|  |  |   |
|--|--|---|
| *1月の全国消費者物価指数(CPI)<br>(市場予想: 前年同月比(除く生鮮)+1.8%) | *1月の米耐久財新規受注<br>*12月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 | *GX5年利付国債入札<br>(8,000億円、2/28発行)<br>*交付税特別会計借入<br>(12,500億円、3/5借入) |
|--|--|---|

◆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場合があります。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