

Central Daily Market Report

2024年2月27日(火)

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27日 需給速報	2024年2月28日 需給予想	2024年2月29日 当社予想			
銀行券	▲ 100	0	▲ 400			
財政	700	▲ 4,800	9,500			
資金過不足	600	▲ 4,800	9,100			
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			1,000			
国債買入						
CP等買入				▲ 300	4,000	
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						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 34,000	33,500		34,000		
*F/L資金供給用担保提供枠						
当預増減	100	29,700	13,100			
当座預金残高	5,369,700	5,399,400	5,412,500			
準備預金残高	4,706,200					
積み終了先	4,704,900			2月28日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,704,900			積数	12,200	
非準備預金先	663,500			1日平均	700	
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	99.68%	日数	41.38%		

●2024年2月27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。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、▲0.105~▲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>

27日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/2/27	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	▲ 0.087	0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.100	0.690	+0.005	39,239.52	+5.81	150.53-56	150.35-36
T/N			▲ 0.002					-	▲ 0.103						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.004	▲ 0.001	▲ 0.003					-	▲ 0.099						
2W	▲ 0.003	▲ 0.001	▲ 0.002					-	▲ 0.100						
3W								-	▲ 0.102						
1M			▲ 0.001					-	▲ 0.100						
3M								▲ 0.100	▲ 0.062						
6M								▲ 0.070	▲ 0.037						
1Y								0.025	0.011						
										日付	2/19	2/20	2/21	2/22	2/26
										日銀当預残	5,363,800	5,360,300	5,342,100	5,372,300	5,369,600
										準備預金残	4,688,400	4,685,500	4,664,100	4,684,700	4,684,600
										マネタリーベース	6,622,300	6,619,300	6,601,500	6,632,600	6,629,700
										無担O/N加重平均	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.005%	▲ 0.006%
										コール市場残高	202,584	209,040	206,400	209,778	198,808
										うち無担	173,424	178,939	175,540	178,847	171,132
										うちO/N	82,866	86,216	83,777	93,464	87,859
										うち有担	29,160	30,101	30,860	30,931	27,676

●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1非価格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
GX5年利付国債	1	0.3%	8,000	2024/2/28	2028/12/20	27,145	7,998	99.81	0.339%	94.0540%				
交付税特会	-	-	12,500	2024/3/5	2024/9/4	157,520	12,480.14		0.000%	10.1284%		0.000%		20

●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
国庫短期証券買入	1,000	2024/2/28			5,115	1,000	0.023		0.023	74.4
米ドル資金供給		2024/2/29	2024/3/7	5.580	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/27	2024/2/28	▲0.350	34,229	34,229		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/27	2024/2/28	▲0.350	47	47		▲0.350	▲0.350	

種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円・百万ドル)	貸付先数
成長基盤強化	米ドル特則第39期(借り換え)	2024/3/4	2025/3/4	1,004	11
成長基盤強化	米ドル特則第35期(借り換え)	2024/3/4	2025/3/4	1,093	10

●2024年2月28日の予定

*12月の景気動向指数改訂状況

*10-12月期の米GDP改定値

*2月の米CB消費者信頼感指数

◆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