

Central Daily Market Report

2024年2月28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28日 需給速報	2024年2月29日 需給予想	2024年3月1日 当社予想			
銀行券	0	▲ 100	▲ 500			
財政	▲ 5,400	11,400	▲ 30,000			
資金過不足	▲ 5,400	11,300	▲ 30,500			
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	1,000					
国債買入		7,500				
CP等買入		▲ 300	4,000	▲ 2,700		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200				
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 34,600	34,000		34,600		
* FDL資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 5,500		54,700		▲ 30,500	
当座預金残高	5,364,200		5,418,900		5,388,400	
準備預金残高	4,692,100					
積み終了先	4,690,400					
超過準備	4,690,400					
非準備預金先	672,100					
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	99.72%	日数	44.83%		

●2024年2月28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、▲0.11~▲0.095%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>

28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

2024/2/28	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	0.003	▲0.006					-	▲0.100	0.695	+0.005	39,208.03	▲31.49	150.50-52	150.74-75
T/N			▲0.002					-	▲0.109						
S/N								-	-						
1W	▲0.004	0.001	▲0.002					-	▲0.099						
2W								-	▲0.099						
3W								-	▲0.100						
1M			0.005					-	▲0.100						
3M			0.110					▲0.105	▲0.059						
6M								▲0.070	▲0.036						
1Y								0.025	0.012						
										日付	2/20	2/21	2/22	2/26	2/27
										日銀当預残	5,360,300	5,342,100	5,372,300	5,369,600	5,369,700
										準備預金残	4,685,500	4,664,100	4,684,700	4,684,600	4,706,200
										マネタリーベース	6,619,300	6,601,500	6,632,600	6,629,700	6,629,900
										無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.006%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.006%
										コール市場残高	209,040	206,400	209,778	198,808	203,845
										うち無担	178,939	175,540	178,847	171,132	177,073
										うちO/N	86,216	83,777	93,464	87,859	92,330
										うち有担	30,101	30,860	30,931	27,676	26,772

●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
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/2/29			8,922	4,752	0.005		0.009	80.7
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/2/29			2,665	1,504	0.021		0.024	56.3
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/2/29			2,480	753	0.034		0.035	4.6
国債買入(物価連動債)	600	2024/2/29			2,821	600	▲0.560		▲0.570	12.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/28	2024/2/29	▲0.350	34,962	34,962		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/28	2024/2/29	▲0.350	0	0				

●2024年2月29日の予定

*滋賀県金融経済懇談会において高田日銀審議委員講演	*1月の米個人所得・消費支出(PCE)	*2年利付国債入札
*1月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比▲7.3%)	*2月のシカゴPM景況感指数	(29,000億円、3/1発行)
*1月の商業動態統計速報		
*1月の住宅着工統計		

◆本資料は信頼できると思わ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