

# Central Daily Market Report

2024年2月2日(金)

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2日 需給速報	2024年2月5日 需給予想	2024年2月6日 当社予想			
銀行券	800	900	500			
財政	▲ 101,600	▲ 2,000	▲ 2,500			
資金過不足	▲ 100,800	▲ 1,100	▲ 2,000			
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			14,600			
CP等買入		▲ 300	▲ 100			
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	▲ 33,300	34,300	33,300			
*F/FL資金供給用担保提供枠						
当増減	▲ 100,100	46,700	▲ 2,000			
当座預金残高	5,302,800	5,349,500	5,347,500			
準備預金残高	4,624,700					
積み終了先	4,623,700			2月5日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,623,700			積数	4,200	
非準備預金先	678,100			1日平均	400	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					4,040,400	
準備預金進捗率	実績	99.90%	日数	64.52%		

## ●2024年2月2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▲0.008~▲0.003%近辺の出合いが始まった。引き続きビッドサイドのニーズが強いなか、週末3日積み要因も重なったことで、出合いの水準は上昇した。  
ターム物は目立った出合いなく閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.06~0%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>

2日はTB3M物(第1210回)の入札が実施され無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小甘い推移となった。この他、1Y物でも出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2024/2/2	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	▲ 0.008					-	▲ 0.070	0.655	▲ 0.035	36,158.02	+146.56	146.46-48	146.62-64
T/N			▲ 0.005					-	▲ 0.071						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.020					-	▲ 0.081						
2W	▲ 0.015	0.200	0.013					-	▲ 0.088						
3W								-	▲ 0.096						
1M	▲ 0.002	0.001	0.000					-	▲ 0.103						
3M								▲ 0.140	▲ 0.123						
6M								▲ 0.170	▲ 0.093						
1Y								▲ 0.045	▲ 0.057						
										日付	1/26	1/29	1/30	1/31	2/1
										日銀当預残	5,393,400	5,406,000	5,434,900	5,436,900	5,402,900
										準備預金残	4,700,600	4,715,800	4,740,900	4,728,000	4,720,400
										マネタリーベース	6,659,300	6,671,300	6,699,500	6,700,800	6,666,500
										無担O/N加重平均	▲ 0.010%	▲ 0.011%	▲ 0.011%	▲ 0.011%	▲ 0.010%
										コール市場残高	197,013	209,290	197,364	178,976	186,512
										うち無担	170,082	179,881	167,843	149,610	156,433
										うちO/N	74,949	88,953	75,870	72,192	73,675
										うち有担	26,931	29,409	29,521	29,366	30,079

## ●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)
国庫短期証券	1210	-	56,000	2024/2/5	2024/5/13	131,203	45,314.2	100.0360	▲0.1340%	43.0931%	100.0387	▲0.1440%	10,685

## ●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年以下)	1,500	2024/2/5			4,336	1,500	0.011		0.013	74.4
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/2/5			12,118	3,759	▲0.002		▲0.001	43.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/2/5			10,640	4,256	▲0.009		▲0.008	44.0
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/2/5			10,229	4,755	▲0.023		▲0.018	27.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/2	2024/2/5	▲0.350	33,535	33,535		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/2	2024/2/5	▲0.350	0	0				

## ●2024年2月5日の予定

*2月の日銀当座預金増減要因見込み	*1月のISM非製造業景況指数	*10年物債連動国債(2,500億円、2/6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