

# Central Daily Market Report

2024年2月5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5日 需給速報	2024年2月6日 需給予想	2024年2月7日 当社予想			
銀行券	900	700	1,000			
財政	▲ 1,500	▲ 5,400	2,000			
資金過不足	▲ 600	▲ 4,700	3,000			
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						▲ 8,500
国債買現	49,900		29,600	▲ 49,900		
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	14,600					
CP等買入		▲ 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	▲ 36,400	33,300		36,400		
当預増減	60,700	11,400		▲ 5,500		
当座預金残高	5,363,500	5,374,900		5,369,400		
準備預金残高	4,679,700					
積み終了先	4,679,200				2月6日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,678,700				積数	3,300
非準備預金先	683,800				1日平均	300
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	99.92%		日数		67.74%

## ●2024年2月5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▲0.009~▲0.003%近辺の出会いで始まった。週末3日積み要因が剥落したものの、依然としてビッドサイドのニーズが強く、レートは前営業日比で概ね横這い圏での推移となった。ターム物はショートタームで引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.08~▲0.075%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。

また本日は、前営業日のGCレートの上昇を受けて、国債買現先オペが2本オファーされた。

### <短国市場>

5日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP市場は、入札が少なく閑散としていた。発行レートが目線に変更はなかった。

## ●短期金融市場関連指標

2024/2/5	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	売買参考指標	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					-	▲ 0.068	0.715	+0.060	36,354.16	+196.14	148.50-52	148.47-49
T/N			▲ 0.005					-	▲ 0.083						
S/N								-	-						
1W			▲ 0.010					-	▲ 0.088						
2W	▲ 0.008	▲ 0.001	▲ 0.005					-	▲ 0.092						
3W								-	▲ 0.098						
1M	▲ 0.013	0.001	▲ 0.005					-	▲ 0.104						
3M								▲ 0.140	▲ 0.125						
6M								▲ 0.170	▲ 0.091						
1Y								▲ 0.045	▲ 0.053						
										日付	1/29	1/30	1/31	2/1	2/2
										日銀当預残	5,406,000	5,434,900	5,436,900	5,402,900	5,302,800
										準備預金残	4,715,800	4,740,900	4,728,000	4,720,400	4,624,700
										マネタリーベース	6,671,300	6,699,500	6,700,800	6,666,500	6,565,500
										無担O/N加重平均	▲ 0.011%	▲ 0.011%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.008%
										コール市場残高	209,290	197,364	178,976	186,512	187,308
										うち無担	179,881	167,843	149,610	156,433	155,371
										うちO/N	88,953	75,870	72,192	73,675	72,573
										うち有担	29,409	29,521	29,366	30,079	31,937

## ●入札結果

名称	回数	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)
物価連動10年	28	0.005%	2,500	2024/2/6	2033/3/10	7,496	2,500	104.50	▲0.468%	30.0000%			

## ●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
国債買現先・即日※1	50,000	2024/2/5	2024/2/6		49,736	49,736		▲0.100	▲0.099	
国債買現先※2	40,000	2024/2/6	2024/2/16		31,100	31,100		▲0.100	▲0.093	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/5	2024/2/6	▲0.350	36,567	36,567		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/5	2024/2/6	▲0.350	0	0				

※1.応札レート(期間利回り)は、-0.10%を下限とします。 ※2.応札レート(期間利回り)は、-0.10%を下限とします。

## ●2024年2月6日の予定

- \*12月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲2.1%)
- \*12月の毎月勤労統計調査速報

◆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