

Central Daily Market Report

2024年2月7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7日 需給速報	2024年2月8日 需給予想	2024年2月9日 当社予想			
銀行券	400	500	1,000			
財政	4,600	▲ 9,400	6,000			
資金過不足	5,000	▲ 8,900	7,000			
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	7,500	▲ 8,500				
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				▲ 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	33,200		33,300		
当預増減	4,900	24,300		7,000		
当座預金残高	5,345,700	5,370,000		5,377,000		
準備預金残高	4,671,600					
積み終了先	4,670,900			2月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,670,900			積数	1,900	
非準備預金先	674,100			1日平均	200	
積み期間(1/16~2/15)の所要準備額					4,044,000	
準備預金進捗率	実績	99.95%		日数	74.19%	

●2024年2月7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▲0.006~▲0.002%近辺の出会いが始まった。一巡後は出し手の調整による散発的な出会いのみで本日の取引を終えた。
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、▲0.095~▲0.07%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。

<短国市場>

7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発行市場は、小口の案件が中心だったが、一部業態から大型発行も実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2024/2/7	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	
	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				-	▲0.082	0.704	▲0.011	36,119.92	▲40.74	147.82-83	147.82-83
T/N			▲0.003				-	▲0.090						
S/N							-	-						
1W	▲0.010	0.030	▲0.002				-	▲0.089						
2W			▲0.010				-	▲0.093						
3W							-	▲0.099						
1M							-	▲0.104						
3M			0.480				▲0.140	▲0.121						
6M							▲0.145	▲0.089						
1Y							▲0.045	▲0.051						
									日付	1/31	2/1	2/2	2/5	2/6
									日銀当預残	5,436,900	5,402,900	5,302,800	5,363,500	5,340,800
									準備預金残	4,728,000	4,720,400	4,624,700	4,679,700	4,662,000
									マネタリーベース	6,700,800	6,666,500	6,565,500	6,625,300	6,601,800
									無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.010%	▲0.008%	▲0.008%	▲0.007%
									コール市場残高	178,976	186,512	187,308	186,712	201,006
									うち無担	149,610	156,433	155,371	157,008	172,062
									うちO/N	72,192	73,675	72,573	73,060	84,094
									うち有担	29,366	30,079	31,937	29,704	28,944

●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)
30年利付国債	81	1.6%	9,000	2024/2/8	2053/12/20	23,022	7,238	96.10	1.800%	86.8756%	96.27	1.791%	1,753

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/7	2024/2/8	▲0.350	33,624	33,624		▲0.350	▲0.351	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/7	2024/2/8	▲0.350	5	5		▲0.350	▲0.350	

●2024年2月8日の予定

*12月の国際収支 *1月の景気ウォッチャー調査	*12月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1211回)入札 (6ヶ月、40,000億円、2/13発行) *エネルギー対策借入 (6,500億円、2/20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