

# Central Daily Market Report

2024年2月16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16日 需給速報	2024年2月19日 需給予想	2024年2月20日 当社予想			
銀行券	0	400	▲ 500			
財政	4,000	▲ 5,200	▲ 1,000			
資金過不足	4,000	▲ 4,800	▲ 1,500			
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		▲ 54,000				
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,300					
CP等買入		▲ 200				
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	▲ 38,000	35,200	38,000			
当増増減	▲ 42,700	33,200	▲ 1,500			
当座預金残高	5,367,200	5,400,400	5,398,900			
準備預金残高	4,697,600					
積み終了先	4,681,100			2月19日以降の残り所要積立額		
超過準備	3,458,500			積数	55,700	
非準備預金先	669,600			1日平均	2,100	
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	98.52%	日数	10.34%		

## ●2024年2月16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~▲0.003%近辺で出合いが見られ、引き続き地銀業態を中心に調達ニーズの強い展開となった。新積み期間に入る以前から、ターム物のレート水準が上昇していた事も影響し、積み初日のO/N物のレート水準としては高めの推移となった。ターム物は、ショートタームで引き合いが見られたが、オファーが少なく閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.080%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>

16日はTB3M物(第1213回)の入札が実施され、強めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでも堅調な推移となった。

### <CP市場>

CP発行市場は、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。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

2024/2/16	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					-	▲ 0.080	0.725	0.000	38,487.24	+329.30	149.94-96	150.23-24
T/N			▲ 0.003					-	▲ 0.080						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.013	▲ 0.001	▲ 0.005					-	▲ 0.084						
2W	▲ 0.010	0.000	▲ 0.007					-	▲ 0.089						
3W								-	▲ 0.091						
1M	▲ 0.013	0.010	▲ 0.003					-	▲ 0.095						
3M								▲ 0.116	▲ 0.095						
6M								▲ 0.104	▲ 0.071						
1Y								▲ 0.040	▲ 0.043						
									日付	2/8	2/9	2/13	2/14	2/15	
									日銀当預残	5,336,000	5,353,700	5,348,700	5,324,000	5,409,900	
									準備預金残	4,661,300	4,673,800	4,676,300	4,654,400	4,741,100	
									マネタリーベース	6,596,200	6,613,100	6,607,900	6,582,800	6,668,700	
									無担O/N加重平均	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	
									コール市場残高	198,327	184,279	186,094	176,910	179,102	
									うち無担	168,831	154,154	156,667	148,433	150,598	
									うちO/N	85,773	77,806	74,719	67,285	69,280	
									うち有担	29,496	30,125	29,427	28,477	28,504	

## ●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	1213	-	58,000	2024/2/19	2024/5/27	126,726.8	46,941.7	100.0295	▲ 0.1098%	84.6566%	100.0311	▲ 0.1157%	11,058
流動性供給	399	-	5,000	2024/2/19	-	14,292	4,988		0.013%	35.4072%		0.009%	

## ●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
社債等買入	1,000	2024/2/21			1,591	1,000	0.292		0.316	55.4
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/16	2024/2/19	▲ 0.350	38,315	38,315		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/16	2024/2/19	▲ 0.350	0	0				

## ●2024年2月19日の予定

*12月の機械受注統計 (市場予想: 船舶・電力除く 民需、前月比+2.5%)	*New York祝日(Presidents' Day)	*国庫短期証券(1214回)入札 (1年、35,000億円、2/20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