

Central Daily Market Report

2024年2月19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19日 需給速報		2024年2月20日 需給予想		2024年2月21日 当社予想	
銀行券	400		▲ 400		▲ 500	
財政	▲ 5,200		▲ 2,900		▲ 17,000	
資金過不足	▲ 4,800		▲ 3,300		▲ 17,500	
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						▲ 7,500
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
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				▲ 100	1,000	
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 36,600	38,000		36,600		
* FDL資金供給用担保提供枠						
当増減	▲ 3,400		33,100		▲ 24,000	
当座預金残高	5,363,800		5,396,900		5,372,900	
準備預金残高	4,688,400					
積み終了先	4,675,000					2月20日以降の残り所要積立額
超過準備	4,674,100					積数 41,100
非準備預金先	675,400					1日平均 1,600
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	98.91%	日数	13.79%		

●2024年2月19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た。3日積み要因は剥落したが、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、レート水準は前営業日から変わらず、横這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、▲0.095~▲0.085%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>

19日はTB1Y物(第1214回)の入札が実施され、テールが流れる弱めの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、小甘く推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、複数の業態から発行が見られた。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

2024/2/19	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	売買参考計値	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	▲ 0.085	0.001	▲ 0.006					-	▲ 0.092	0.725	0.000	38,470.38	▲ 16.86	150.14-16	149.97-99
T/N			▲ 0.003					-	▲ 0.091						
S/N								-	-						
1W								-	▲ 0.092						
2W	▲ 0.003	0.050	0.000					-	▲ 0.094						
3W								-	▲ 0.096						
1M								-	▲ 0.099						
3M								▲ 0.116	▲ 0.087						
6M								▲ 0.104	▲ 0.067						
1Y								0.030	▲ 0.029						
										日付	2/9	2/13	2/14	2/15	2/16
										日銀当預残	5,353,700	5,348,700	5,324,000	5,409,900	5,367,200
										準備預金残	4,673,800	4,676,300	4,654,400	4,741,100	4,698,100
										マネタリーベース	6,613,100	6,607,900	6,582,800	6,668,700	6,626,100
										無担O/N加重平均	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.006%
										コール市場残高	184,279	186,094	176,910	179,102	213,979
										うち無担	154,154	156,667	148,433	150,598	183,869
										うちO/N	77,806	74,719	67,285	69,280	92,211
										うち有担	30,125	29,427	28,477	28,504	30,110

●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	1214	-	35,000	2024/2/20	2025/2/20	81,865	28,362.8	99.953	0.0468%	98.6666%	99.987	0.0129%	6.637

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/19	2024/2/20	▲0.350	36,926	36,926		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/19	2024/2/20	▲0.350	0	0				

●2024年2月20日の予定

*20年利付国債入札 (10,000億円、2/21発行)	*交付税特別会計借入 (12,500億円、2/29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よう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場合があります。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