

Central Daily Market Report

2024年2月20日(火)

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20日 需給速報	2024年2月21日 需給予想	2024年2月22日 当社予想			
銀行券	▲ 500	▲ 300	▲ 500			
財政	▲ 4,400	▲ 18,000	13,000			
資金過不足	▲ 4,900	▲ 18,300	12,500			
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			7,100	▲ 7,500		
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		▲ 500		
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	▲ 35,000	36,600		35,000		
*FDR資金供給用担保提供額						
当増減	▲ 3,500		17,800			12,500
当座預金残高	5,360,300		5,378,100			5,390,600
準備預金残高	4,685,500					
積み終了先	4,677,400				2月21日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,676,300				積数	31,900
非準備預金先	674,800				1日平均	1,300
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	99.15%	日数	17.24%		

●2024年2月20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~▲0.002%近辺で出合いが見られた。引き続き地銀業態を中心に調達ニーズが強く、レート水準は横ば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。

<レボ市場>

GC T/Nは、▲0.10~▲0.095%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>

20日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱い結果となった。マーケットでは1Y物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は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

2024/2/20	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レボレート	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					-	▲ 0.095	0.729	+0.004	38,363.61	▲ 106.77	150.26-27	150.35-37
T/N			▲ 0.003					-	▲ 0.099						
S/N			▲ 0.002					-	-						
1W	▲ 0.015	▲ 0.001	▲ 0.009					-	▲ 0.098						
2W	▲ 0.001	0.005	0.001					-	▲ 0.098						
3W			0.001					-	▲ 0.100						
1M								-	▲ 0.104						
3M			0.030					▲ 0.116	▲ 0.075						
6M								▲ 0.104	▲ 0.059						
1Y								0.030	▲ 0.004						
										日付	2/13	2/14	2/15	2/16	2/19
										日銀当預残	5,348,700	5,324,000	5,409,900	5,367,200	5,363,800
										準備預金残	4,676,300	4,654,400	4,741,100	4,698,100	4,688,400
										マネタリーベース	6,607,900	6,582,800	6,668,700	6,626,100	6,622,300
										無担O/N加重平均	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.006%	▲ 0.006%
										コーポ市場残高	186,094	176,910	179,102	213,979	202,584
										うち無担	156,667	148,433	150,598	183,869	173,424
										うちO/N	74,719	67,285	69,280	92,211	82,866
										うち有担	29,427	28,477	28,504	30,110	29,160

●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)	非競争入札(億円)
20年利付国債	187	1.3%	10,000	2024/2/21	2043/12/20	31,101	8,073	96.75	1.513%	73.2684%	96.79	1.510%	1,920	
交付税特会	-	-	12,500	2024/2/29	2024/8/30	292,685	12,490.06		0.000%	4.3484%		0.000%		10

●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)	着札総額(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	平均着札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国庫短期証券買入	1,000	2024/2/21			6,255	1,000	0.027		0.047	71.0
米ドル資金供給		2024/2/22	2024/2/29	5.580	8	8				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/20	2024/2/21	▲ 0.350	35,291	35,291		▲ 0.350	▲ 0.350	
共通担保資金供給(全店)＜固定金利・金額無制限＞		2024/2/21	2024/3/6	0.000	7,122	7,122				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/20	2024/2/21	▲ 0.350	28	28		▲ 0.350	▲ 0.350	
米ドル資金供給用担保国債供給(国債売現先)	5,000	2024/2/21	2024/3/1		2	2		▲ 0.100	▲ 0.100	

●2024年2月21日の予定

*月例経済報告	*1月の貿易統計
---------	----------

◆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