

Central Daily Market Report

2024年2月29日(木)

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29日 需給速報	2024年3月1日 需給予想	2024年3月4日 当社予想				
銀行券	0	▲ 200	500				
財政	14,500	▲ 31,500	▲ 60,000				
資金過不足	14,500	▲ 31,700	▲ 59,500				
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							
国債売現							
国庫短期証買入							
国債買入	7,500						
CP等買入	4,000	▲ 2,700		▲ 200			
貸出支援基金(成)						▲ 2,200	
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							
E T F買入							
国債補充供給	▲ 36,700	34,600		36,700			
当預増減	21,200		4,800		▲ 61,700		
当座預金残高	5,385,400		5,390,200		5,328,500		
準備預金残高	4,697,100						
積み終了先	4,695,600					3月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,695,600					積数	9,000
非準備預金先	688,300					1日平均	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	99.76%		日数	48.28%		

●2024年2月29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。月末日の取引となり調達を見合わせる先も一部で見られたが、引き続き邦銀業態を中心に調達ニーズが強い展開に大きな変化はなく、レートは概ね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▲0.003~▲0.001%近辺で出合いが散見される程度であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.100%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>

29日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2024/2/29	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	▲ 0.005				-	▲ 0.100	0.710	+0.015	39,166.19	▲ 41.84	150.63-65	149.66-69
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.106						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.007	▲ 0.003	▲ 0.006				-	▲ 0.100						
2W			▲ 0.010				-	▲ 0.099						
3W			▲ 0.001				-	▲ 0.100						
1M	▲ 0.001	0.170	0.024				-	▲ 0.099						
3M							▲ 0.105	▲ 0.055						
6M							▲ 0.070	▲ 0.033						
1Y							0.025	0.012						
日付	2/21	2/22	2/26	2/27	2/28									
日銀当預残	5,342,100	5,372,300	5,369,600	5,369,700	5,364,200									
準備預金残	4,664,100	4,684,700	4,684,600	4,706,200	4,692,500									
マネタリーベース	6,601,500	6,632,600	6,629,700	6,629,900	6,624,400									
無担O/N加重平均	▲ 0.006%	▲ 0.005%	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.006%									
コール市場残高	206,400	209,778	198,808	203,845	210,580									
うち無担	175,540	178,847	171,132	177,073	182,131									
うちO/N	83,777	93,464	87,859	92,330	97,178									
うち有担	30,860	30,931	27,676	26,772	28,449									

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第I非価格競争入札(億円)
2年利付国債	458	0.2%	29,000	2024/3/1	2026/3/1	84,905	23,471	100.025	0.187%	44.4219%	100.039	0.180%	5,525

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/2/29	2024/3/1	▲0.350	37,048	37,048		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/2/29	2024/3/1	▲0.350	1	1		▲0.350	▲0.350	

●2024年3月1日の予定

*1月の完全失業率(市場予想:2.4%)	*2月のISM製造業景況指数	*国庫短期証券(1216回)入札(3ヶ月、58,000億円、3/4発行)
*1月の有効求人倍率(市場予想:1.27倍)	*1月の米建設支出	*交付税特別会計借入(11,950億円、3/8借入)
*2月の消費動向調査	*2月のユーロ圏消費者物価指数速報値	

◆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