

Central Daily Market Report

2024年3月1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3月1日 需給速報	2024年3月4日 需給予想	2024年3月5日 当社予想			
銀行券	▲ 100	400	▲ 100			
財政	▲ 37,200	▲ 48,300	2,000			
資金過不足	▲ 37,300	▲ 47,900	1,900			
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						
CP等買入		▲ 200				
貸出支援基金(成)				▲ 1,900		
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						
国債補完供給	▲ 33,100	36,700		33,100		
*F/R資金供給用担保提供額						
当預増減	▲ 33,900	▲ 16,700				1,900
当座預金残高	5,351,500	5,334,800				5,336,700
準備預金残高	4,700,700					
積み終了先	4,699,600				3月4日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,699,400				積数	5,300
非準備預金先	650,800				1日平均	400
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	99.86%		日数		58.62%

●2024年3月1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。引き続き邦銀業態を中心に調達ニーズが強いなかでの週末3日積みとなったが、上昇余地が限られるため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%近辺での引き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>

1日はTB3M物(第1216回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<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

2024/3/1	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	▲0.005					-	▲0.099	0.714	+0.004	39,910.82	+744.63	150.06-08	150.49-50
T/N			▲0.002					-	▲0.100						
S/N								-	-						
1W	▲0.040	0.001	▲0.035					-	▲0.099						
2W	▲0.013	0.200	0.002					-	▲0.099						
3W								-	▲0.100						
1M	0.020	0.310	0.072					-	▲0.099						
3M								▲0.096	▲0.053						
6M								▲0.070	▲0.033						
1Y								0.025	0.012						
									日付	2/22	2/26	2/27	2/28	2/29	
									日銀当預残	5,372,300	5,369,600	5,369,700	5,364,200	5,385,400	
									準備預金残	4,684,700	4,684,600	4,706,200	4,692,500	4,696,800	
									マネタリーベース	6,632,600	6,629,700	6,629,900	6,624,400	6,645,600	
									無担O/N加重平均	▲0.005%	▲0.006%	▲0.006%	▲0.006%	▲0.005%	
									コール市場残高	209,778	198,808	203,845	210,580	192,812	
									うち無担	178,847	171,132	177,073	182,131	166,759	
									うちO/N	93,464	87,859	92,330	97,178	91,816	
									うち有担	30,931	27,676	26,772	28,449	26,053	

●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)
国庫短期証券	1216	-	58,000	2024/3/4	2024/6/10	125,210	46,931.5	100.0230	▲0.0856%	74.5535%	100.0258	▲0.0960%	11,068	
交付税特会	-	-	11,950	2024/3/8	2024/9/9	70,150	11,930.02		0.000%	46.8765%		0.000%		20

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/1	2024/3/4	▲0.350	33,241	33,241		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/1	2024/3/4	▲0.350	210	210		▲0.350	▲0.350	

●2024年3月4日の予定

- *2月のマネタリーベース
- *10-12月期の法人企業統計調査季報
- *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み

◆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