

Central Daily Market Report

2024年3月4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3月4日 需給速報	2024年3月5日 需給予想	2024年3月6日 当社予想				
銀行券	400	700	300				
財政	▲ 47,400	▲ 1,300	▲ 27,000				
資金過不足	▲ 47,000	▲ 600	▲ 26,700				
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	
国債買現							
国債売現							
国庫短期証買入			7,400				
国債買入							
CP等買入				▲ 400			
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							
E T F買入							
国債補充供給	▲ 31,000	33,100		31,000			
* FTL資金供給用担保提供供給							
当増増減	▲ 46,800		37,400		▲ 33,800		
当座預金残高	5,304,700		5,342,100		5,308,300		
準備預金残高	4,654,100						
積み終了先	4,653,000					3月5日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,653,000					積数	4,200
非準備預金先	650,600					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	99.89%		日数	62.07%		

●2024年3月4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。週末要因は剥落したものの、引き続き邦銀業態からの資金調達ニーズが強く、レートは概ね横ばい圏での推移となった。ターム物は、ショートタームでの引き合いが散見された。

<レボ市場>

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>

4日のアウトラ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発行市場は小口の案件が中心となったが、一部業態からは大型発行も実施された。発行レートに目立った変動は見られなかった。

●短期金融市場関連指標

2024/3/4	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					-	▲ 0.098	0.710	▲ 0.004	40,109.23	+198.41	150.12-14	150.30-32
T/N			▲ 0.002					-	▲ 0.102						
S/N								-	-						
1W	▲ 0.010	0.001	▲ 0.001					-	▲ 0.100						
2W			0.000					-	▲ 0.102						
3W			0.005					-	▲ 0.103						
1M			0.170					-	▲ 0.102						
3M								▲ 0.096	▲ 0.052						
6M								▲ 0.070	▲ 0.029						
1Y								0.025	0.015						
										日付	2/26	2/27	2/28	2/29	3/1
										日銀当預残	5,369,600	5,369,700	5,364,200	5,385,400	5,351,500
										準備預金残	4,684,600	4,706,200	4,692,500	4,696,800	4,700,700
										マネタリーベース	6,629,700	6,629,900	6,624,400	6,645,600	6,612,000
										無担O/N加重平均	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.005%	▲ 0.005%
										コール市場残高	198,808	203,845	210,580	192,812	203,910
										うち無担	171,132	177,073	182,131	166,759	176,559
										うちO/N	87,859	92,330	97,178	91,816	101,556
										うち有担	27,676	26,772	28,449	26,053	27,351

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2024/3/5			3,223	1,501	0.013		0.014	66.5
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/3/5			14,239	3,752	▲ 0.001		0.001	88.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/3/5			3,052	1,503	0.004		0.006	73.3
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/3/5			2,484	753	0.008		0.010	31.5
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/4	2024/3/5	▲ 0.350	31,357	31,357		▲ 0.350	▲ 0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/4	2024/3/5	▲ 0.350	3	3		▲ 0.350	▲ 0.350	

●2024年3月5日の予定

*FIN/SUM(フィンサム)2024において植田日銀総裁講演	*2月のISM非製造業景況指数	*10年利付国債入札(27,000億円、3/6発行)
*3月の日銀当座預金増減要因見込み	*1月の米製造業新規受注・出荷・在庫	
*2月の都区部消費者物価指数(CPI)(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.5%)		

◆本資料は信頼できると思わ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