

# Central Daily Market Report

2024年3月5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3月5日 需給速報	2024年3月6日 需給予想	2024年3月7日 当社予想				
銀行券	700	400	▲ 500				
財政	▲ 2,000	▲ 24,600	1,000				
資金過不足	▲ 1,300	▲ 24,200	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			8,300	▲ 7,100			
国債買現							
国債売現							
国庫短期証買入			1,000				
国債買入	7,400						
CP等買入		▲ 400		▲ 300			
貸出支援基金(成)							
貸出支援基金(貸)							
被災地支援							
社債等買入				▲ 200			
気候変動対応オペ							
ETF買入							
国債補充供給	▲ 29,200	31,000		29,200			
*ドル資金供給用担保提供額							
当増減	7,500		6,700			500	
当座預金残高	5,312,200		5,318,900			5,319,400	
準備預金残高	4,664,600						
積み終了先	4,663,600						
超過準備	4,663,600						
非準備預金先	647,600						
3月6日以降の残り所要積立額				積数	3,100		
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額				1日平均	300		
準備預金進捗率				実績	99.92%	日数	65.52%

## ●2024年3月5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▲0.008~▲0.003近辺で出会いが見られた。オファーサイドの一部に運用ニーズの強まりが見られた事で、出会いレートは前日対比でやや低下する展開となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.100%程度での出会いとなった。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>

5日は短国買入オペアが前回と同額の1,000億円でオファーされ、やや弱めの結果となった。マーケットでは3M物に出合いが見られた。

### <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

2024/3/5	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	▲ 0.007				-	▲ 0.098	0.699	▲ 0.011	40,097.63	▲ 11.60	150.45-46	150.41-43
T/N			▲ 0.004				-	▲ 0.102						
S/N							-	-						
1W	▲ 0.005	▲ 0.001	▲ 0.003				-	▲ 0.100						
2W			▲ 0.001				-	▲ 0.103						
3W							-	▲ 0.103						
1M							-	▲ 0.102						
3M							▲ 0.095	▲ 0.047						
6M							▲ 0.070	▲ 0.028						
1Y							0.025	0.016						
									日付	2/27	2/28	2/29	3/1	3/4
									日銀当預残	5,369,700	5,364,200	5,385,400	5,351,500	5,304,700
									準備預金残	4,706,200	4,692,500	4,696,800	4,700,700	4,652,900
									マネタリーベース	6,629,900	6,624,400	6,645,600	6,612,000	6,564,700
									無担O/N加重平均	▲ 0.006%	▲ 0.006%	▲ 0.005%	▲ 0.005%	▲ 0.006%
									コール市場残高	203,845	210,580	192,812	203,910	202,000
									うち無担	177,073	182,131	166,759	176,559	173,931
									うちO/N	92,330	97,178	91,816	101,556	96,258
									うち有担	26,772	28,449	26,053	27,351	28,069

## ●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・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償還額募入(億円)	非償還額入札(億円)
10年利付国債	373	0.6%	27,000	2024/3/6	2033/12/20	70,737	21,840	98.88	0.722%	73.4437%	98.92	0.718%	5,148	3.27

## ●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
国庫短期証買入	1,000	2024/3/6			3,424	1,002	0.026		0.026	62.4
米ドル資金供給		2024/3/7	2024/3/14	5.580	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/5	2024/3/6	▲ 0.350	29,484	29,484		▲ 0.350	▲ 0.350	
共通担保資金供給(全店)<固定金利・金額無制限>		2024/3/6	2024/3/19	0.000	8,345	8,345				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/5	2024/3/6	▲ 0.350	0	0				

## ●2024年3月6日の予定

- \*米ページブック
- \*1月の米卸売売上高

◆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