

# Central Daily Market Report

2024年3月6日(水)

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6日 需給速報		2024年3月7日 需給予想		2024年3月8日 当社予想	
銀行券	300		0		500	
財政	▲ 27,600		8,000		▲ 5,000	
資金過不足	▲ 27,300		8,000		▲ 4,500	
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						
CP等買入		▲ 300		▲ 200		
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	▲ 31,900	29,200		31,900		
*FPL資金供給用担保提供枠						
当預増減	▲ 28,300		39,700		▲ 4,500	
当座預金残高	5,283,900		5,323,600		5,319,100	
準備預金残高	4,646,600					
積み終了先	4,646,200		3月7日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,646,000		積数		2,500	
非準備預金先	637,300		1日平均		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	99.93%	日数	68.97%		

## ●2024年3月6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~▲0.004%近辺で出合いが見られた。前日からの流れを受け、引き続きオファーサイドの一部に積極的な運用姿勢が見られた事から、出合い水準は前日比で若干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>

6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、複数の業態から入札が実施され、一部で大型発行も散見された。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

2024/3/6	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	売買参考計値	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	▲0.009					-	▲0.098	0.710	+0.011	40,090.78	▲6.85	150.02-04	149.53-55
T/N			▲0.009					-	▲0.105						
S/N								-	-						
1W	▲0.009	0.001	▲0.004					-	▲0.100						
2W			0.025					-	▲0.100						
3W			▲0.001					-	▲0.099						
1M			0.030					-	▲0.097						
3M								▲0.095	▲0.040						
6M								▲0.070	▲0.017						
1Y								0.025	0.018						
									日付	2/28	2/29	3/1	3/4	3/5	
									日銀当預残	5,364,200	5,385,400	5,351,500	5,304,700	5,312,200	
									準備預金残	4,692,500	4,696,800	4,700,700	4,652,900	4,664,700	
									マネタリーベース	6,624,400	6,645,600	6,612,000	6,564,700	6,571,500	
									無担O/N加重平均	▲0.006%	▲0.005%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.007%	
									コール市場残高	210,580	192,812	203,910	202,000	209,430	
									うち無担	182,131	166,759	176,559	173,931	181,631	
									うちO/N	97,178	91,816	101,556	96,258	101,188	
									うち有担	28,449	26,053	27,351	28,069	27,799	

## ●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*	応募総額(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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/6	2024/3/7	▲0.350	32,130	32,130		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/6	2024/3/7	▲0.350	27	27		▲0.350	▲0.350	

## ●2024年3月7日の予定

*島根県金融経済懇談会において 中川日銀審議委員講演	*ECB定例理事会 *1月の米貿易収支 *1月の米消費者信用残高	*国庫短期証券(1217回)入札 (6ヶ月、40,000億円、3/11発行) *30年利付国債入札 (9,000億円、3/8発行)
-------------------------------	--	--

◆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ものがあります。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