

Central Daily Market Report

2024年3月7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3月7日 需給速報	2024年3月8日 需給予想	2024年3月11日 当社予想			
銀行券	0	700	700			
財政	11,300	5,000	1,000			
資金過不足	11,300	5,700	1,700			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲200		▲500		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲100		
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補完供給	▲29,800	31,900		29,800		
※FPI資金供給用担保提供枠						
当増減	13,200		34,900			1,700
当座預金残高	5,297,100		5,332,000			5,333,700
準備預金残高	4,648,300					
積み終了先	4,647,900				3月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,647,900				積数	2,000
非準備預金先	648,800				1日平均	300
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						3,772,700
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数	72.41%		

●2024年3月7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▲0.01~▲0.008%近辺で出合いが見られた。引き続きオファーサイドの資金運用ニーズが強く、出合いレンジは前日比で低下したものの、ビッド件数が増加したこともあり、一定の水準でレートは下げ止まった。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、▲0.110~▲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>

7日はTB6M物(第1217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。なお、6M物の入札がプラス金利となったのは、2014年11月5日入札以来となった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは政策修正への警戒感から若干の上昇が見られた。また本日は、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でおfferされた。結果は、按分レート+0.032%、平均落札レート+0.057%と、前回(按分+0.011%・平均+0.030%)比で按分、平均ともに大きく上昇した。

●短期金融市場関連指標

2024/3/7	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	売買参考指標	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	▲0.011				-	▲0.098	0.725	+0.015	39,598.71	▲492.07	149.25-26	147.93-95
T/N			0.001				-	▲0.106						
S/N							-	-						
1W			▲0.009				-	▲0.101						
2W			▲0.008				-	▲0.101						
3W							-	▲0.094						
1M							-	▲0.087						
3M							▲0.095	▲0.036						
6M							0.014	▲0.006						
1Y							0.025	0.024						
									日付	2/29	3/1	3/4	3/5	3/6
									日銀当預残	5,385,400	5,351,500	5,304,700	5,312,200	5,283,900
									準備預金残	4,696,800	4,700,700	4,652,900	4,664,700	4,638,800
									マネタリーベース	6,645,600	6,612,000	6,564,700	6,571,500	6,542,900
									無担O/N加重平均	▲0.005%	▲0.005%	▲0.006%	▲0.007%	▲0.009%
									コール市場残高	192,812	203,910	202,000	209,430	212,900
									うち無担	166,759	176,559	173,931	181,631	184,820
									うちO/N	91,816	101,556	96,258	101,188	104,677
									うち有担	26,053	27,351	28,069	27,799	28,080

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1217	-	40,000	2024/3/11	2024/9/10	126,746	33,437.6	99.979	0.0418%	57.0344%	99.987	0.0259%	6,562
30年利付国債	81	1.6%	9,000	2024/3/8	2053/12/20	21,251	7,242	96.30	1.790%	73.1060%	96.67	1.770%	1,753

●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
CP等買入	4,000	2024/3/12			12,495	3,995	0.032		0.057	43.2
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/7	2024/3/8	▲0.350	30,118	30,118		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/7	2024/3/8	▲0.350	4	4		▲0.350	▲0.350	

●2024年3月8日の予定

*1月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲4.3%)	*2月の米雇用統計	*国庫短期証券(1218回)入札(3ヶ月、58,000億円、3/11発行)
*1月の国際収支	*10-12月期のユーロ圏GDP確報値	
*1月の景気動向指数速報		
*2月の景気ウォッチャー調査		
国債補完供給		

◆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