

# Central Daily Market Report

2024年3月8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8日 需給速報	2024年3月11日 需給予想	2024年3月12日 当社予想			
銀行券	600	400	500			
財政	4,800	▲1,500	▲1,000			
資金過不足	5,400	▲1,100	▲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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入		13,000				
CP等買入		▲500	▲100	4,000		
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						
国債補充供給	▲29,800	29,800	29,800			
*FDR資金供給用担保提供額						
当増減	4,800	41,600	3,500			
当座預金残高	5,301,900	5,343,500	5,347,000			
準備預金残高	4,647,800					
積み終了先	4,647,300			3月11日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,647,300			積数	500	
非準備預金先	654,100			1日平均	100	
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	99.99%	日数	82.76%		

## ●2024年3月8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▲0.010~▲0.007%近辺で出合いが見られた。今週はレート水準が低下傾向となっていたが、週末3日積み要因による資金調達ニーズは底堅く、出合い水準は前日比で若干上昇する展開となった。  
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>

8日はTB3M物(第1218回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセダラーでも底堅く推移した。

### <CP市場>

CP発行市場は数件の発行が観測され、一部大型発行も見られた。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。

## ●短期金融市場関連指標

2024/3/8	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	▲0.010					-	▲0.099	0.730	+0.005	39,688.94	+90.23	147.86-87	147.87-89
T/N								-	▲0.104						
S/N								-	-						
1W	▲0.009	0.001	▲0.009					-	▲0.098						
2W								-	▲0.096						
3W								-	▲0.090						
1M								-	▲0.083						
3M								▲0.058	▲0.022						
6M								0.010	0.008						
1Y								0.025	0.031						
										日付	3/1	3/4	3/5	3/6	3/7
										日銀当預残	5,351,500	5,304,700	5,312,200	5,283,900	5,297,100
										準備預金残	4,700,700	4,652,900	4,664,700	4,638,800	4,648,300
										マネタリーベース	6,612,000	6,564,700	6,571,500	6,542,900	6,556,100
										無担O/N加重平均	▲0.005%	▲0.006%	▲0.007%	▲0.009%	▲0.011%
										コール市場残高	203,910	202,000	209,430	212,900	217,330
										うち無担	176,559	173,931	181,631	184,820	188,127
										うちO/N	101,556	96,258	101,188	104,677	108,814
										うち有担	27,351	28,069	27,799	28,080	29,203

## ●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非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1218	-	58,000	2024/3/11	2024/6/17	121,262	46,931.7	100.0110	▲0.0409%	94.3158%	100.0163	▲0.0606%	11,068

## ●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年超3年以下)	3,750	2024/3/11			11,489	3,755	0.008		0.011	28.3
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/3/11			9,927	4,256	0.007		0.010	83.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/3/11			11,501	4,756	0.011		0.012	26.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/8	2024/3/11	▲0.350	30,124	30,124		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/8	2024/3/11	▲0.350	0	0				

## ●2024年3月11日の予定

- \*10-12月期のGDP 2次速報(市場予想:前期比年率+1.1%)
- \*2月のマネーストック

◆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