

Central Daily Market Report

2024年3月12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12日 需給速報	2024年3月13日 需給予想	2024年3月14日 当社予想			
銀行券	100	600	500			
財政	2,500	▲23,900	1,000			
資金過不足	2,600	▲23,300	1,500			
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			1,000			
国債買入						
CP等買入	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	▲33,800	34,000		33,800		
*F/FL資金供給用担保提供額						
当預増減	6,800	11,400	1,500			
当座預金残高	5,317,600	5,329,000	5,330,500			
準備預金残高	4,647,000					
積み終了先	4,646,900			3月13日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,646,900			積数	200	
非準備預金先	670,600			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	89.66%		

●2024年3月12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。引き続き調達ニーズが底堅く、出合いの水準は前日から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。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.13~▲0.10%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>

12日は短国買入オペが前回と同額の1,000億円でオファーされ、弱い結果となった。
マーケットでは3M物に出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は数件の発行が観測された。発行レートは政策修正への警戒感からかレートの上昇が見られた。

●短期金融市場関連指標

2024/3/12	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	▲0.011					-	▲0.104	0.765	+0.005	38,797.51	▲22.98	146.73-75	147.33-35
T/N								-	▲0.115						
S/N								-	-						
1W								-	▲0.099						
2W								-	▲0.093						
3W			0.020					-	▲0.086						
1M								-	▲0.077						
3M								▲0.053	▲0.014						
6M								0.010	0.021						
1Y								0.025	0.042						
									日付	3/5	3/6	3/7	3/8	3/11	
									日銀当預残	5,312,200	5,283,900	5,297,100	5,301,900	5,310,800	
									準備預金残	4,664,700	4,638,800	4,648,300	4,648,400	4,651,400	
									マネタリーベース	6,571,500	6,542,900	6,556,100	6,560,300	6,568,700	
									無担O/N加重平均	▲0.007%	▲0.009%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%	
									コール市場残高	209,430	212,900	217,330	215,765	215,387	
									うち無担	181,631	184,820	188,127	185,777	186,818	
									うちO/N	101,188	104,677	108,814	106,319	106,070	
									うち有担	27,799	28,080	29,203	29,988	28,569	

●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)
5年利付国債	166	0.4%	25,000	2024/3/13	2028/12/20	80,719	20,226	100.11	0.376%	60.1203%	100.13	0.372%	4,769
エネルギー対策	-	-	6,900	2024/3/21	2025/3/21	26,500	6,900		0.160%	85.5073%		0.155%	

●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
国庫短期証券買入	1,000	2024/3/13			6,204	1,001	0.032		0.054	15.4
米ドル資金供給		2024/3/14	2024/3/22	5.580	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/12	2024/3/13	▲0.350	34,005	34,005		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/12	2024/3/13	▲0.350	200	200		▲0.350	▲0.353	

●2024年3月13日の予定

*特にありません

◆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