

Central Daily Market Report

2024年3月13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13日 需給速報	2024年3月14日 需給予想	2024年3月15日 当社予想			
銀行券	600	▲ 400	500			
財政	▲ 23,700	7,400	▲ 4,000			
資金過不足	▲ 23,100	7,000	▲ 3,500			
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			▲ 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		▲ 100	▲ 100			
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 30,700	33,800	30,700			
*FDR資金供給用担保提供状況						
当増減	▲ 19,100	37,400	▲ 3,500			
当座預金残高	5,298,500	5,335,900	5,332,400			
準備預金残高	4,635,900					
積み終了先	4,635,900			3月14日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,635,900			積数	100	
非準備預金先	662,600			1日平均	0	
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	100.00%	日数	93.10%		

●2024年3月13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。積み期終盤となってきたが相場に大きな変動はなく、出合い水準は引き続き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、▲0.11~▲0.105%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>

13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、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。発行レートは、前日比で概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2024/3/13	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					-	▲ 0.099	0.755	▲ 0.010	38,695.97	▲ 101.54	147.61-64	147.66-69
T/N								-	▲ 0.110						
S/N								-	-						
1W				0.010				-	▲ 0.094						
2W				0.005				-	▲ 0.084						
3W								-	▲ 0.075						
1M				0.030				-	▲ 0.062						
3M								▲ 0.053	▲ 0.008						
6M								0.010	0.024						
1Y								0.025	0.046						
									日付	3/6	3/7	3/8	3/11	3/12	
									日銀当預残	5,283,900	5,297,100	5,301,900	5,310,800	5,317,600	
									準備預金残	4,638,800	4,648,300	4,648,400	4,651,400	4,647,000	
									マネタリーベース	6,542,900	6,556,100	6,560,300	6,568,700	6,575,300	
									無担O/N加重平均	▲ 0.009%	▲ 0.011%	▲ 0.010%	▲ 0.010%	▲ 0.011%	
									コール市場残高	212,900	217,330	215,765	215,387	216,395	
									うち無担	184,820	188,127	185,777	186,818	188,064	
									うちO/N	104,677	108,814	106,319	106,070	107,521	
									うち有担	28,080	29,203	29,988	28,569	28,331	

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/13	2024/3/14	▲0.350	31,024	31,024		▲0.350	▲0.350	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/13	2024/3/14	▲0.350	50	50		▲0.350	▲0.360	

●2024年3月14日の予定

*2月の米生産者物価指数	*20年利付国債入札(10,000億円、3/15発行)
*2月の米小売売上高	
*1月の米企業在庫	

◆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