

Central Daily Market Report

2024年3月15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15日 需給速報	2024年3月18日 需給予想	2024年3月19日 当社予想	
銀行券	800	400	500	
財政	5,200	10,900	3,000	
資金過不足	6,000	11,300	3,500	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出	エンド	エンド	エンド	
全店共通			▲ 8,300	
国債買現				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入		13,400		
CP等買入	▲ 500			
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)		98,500	▲ 45,900	
被災地支援				
社債等買入	▲ 500	▲ 100		
気候変動対応オペ				
E T F買入				
国債補完供給	▲ 32,100	33,600	32,100	
当増減	6,500	109,300	▲ 4,800	
当座預金残高	5,309,600	5,418,900	5,414,100	
準備預金残高	4,636,200			
積み終了先	4,636,200			
超過準備	4,636,200			
非準備預金先	673,400			
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額			4,047,500	
準備預金進捗率	実績	96.83%	日数	6.45%

●2024年3月15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▲0.005~▲0.001%近辺で出会いが見られた。積み最終日となった事から、出会いの水準は前日比で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、▲0.09~▲0.05%程度での出会いとなった。
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>

15日はTB3M物(第1219回)の入札が実施され、プラス利回りでの決着となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2024/3/15	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート
	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値	平均値
O/N	▲0.087	0.001	▲0.005				-	▲0.086
T/N			0.001				-	▲0.061
S/N							-	-
1W							-	▲0.045
2W			0.030				-	▲0.035
3W							-	▲0.027
1M			0.230				-	▲0.014
3M							0.005	0.021
6M							0.010	0.043
1Y							0.025	0.070

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
0.785	+0.010	38,707.64	▲99.74	148.30-31	148.57-59
日付	3/8	3/11	3/12	3/13	3/14
日銀当預残	5,301,900	5,310,800	5,317,600	5,298,500	5,303,100
準備預金残	4,648,400	4,651,400	4,647,000	4,637,200	4,635,400
マネタリーベース	6,560,300	6,568,700	6,575,300	6,555,700	6,560,600
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.009%
コール市場残高	215,765	215,387	216,395	196,868	202,387
うち無担	185,777	186,818	188,064	168,243	173,895
うちO/N	106,319	106,070	107,521	90,650	98,952
うち有担	29,988	28,569	28,331	28,625	28,492

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1219	-	58,000	2024/3/18	2024/6/24	132,210.7	46,931.9	99.9925	0.0279%	30.0344%	99.9985	0.0055%	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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/3/18			7,565	3,752	0.003		0.008	24.6
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/3/18			8,869	4,252	0.018		0.019	68.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/3/18			8,079	4,755	0.017		0.020	58.5
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/3/18			2,777	754	0.052		0.053	99.2
社債等買入	1,000	2024/3/21			1,545	1,000	0.273		0.303	26.6
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/15	2024/3/18	▲0.350	32,589	32,589		▲0.350	▲0.352	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/15	2024/3/18	▲0.350	0	0				

●2024年3月18日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、19日まで)	*2月のユーロ圏消費者物価指数改定値	*国庫短期証券(1220回)入札(1年、35,000億円、3/21発行)
*1月の機械受注統計(市場予想:船舶・電力除く民需、前月比▲1.0%)		

◆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場合があります。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