

Central Daily Market Report

2024年3月21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21日 需給速報	2024年3月22日 需給予想	2024年3月25日 当社予想	
銀行券	▲ 400	200	500	
財政	75,800	▲ 800	40,000	
資金過不足	75,400	▲ 600	40,500	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出				
全店共通				
国債買現		▲ 28,500		
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入				
CP等買入		▲ 100	▲ 300	
貸出支援基金(成)				
貸出支援基金(貸)				
被災地支援				
社債等買入	1,000			
気候変動対応オペ				
E T F 買入				
国債補完供給	▲ 57,200	42,600	57,200	
当預増減	33,200	56,300	40,500	
当座預金残高	5,468,000	5,524,300	5,564,800	
準備預金残高	4,796,400			
積み終了先	4,784,300			3月22日以降の残り所要積立額
超過準備	4,778,800			積数 24,800
非準備預金先	671,600			1日平均 1,000
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 99.39%	日数 19.35%		

●2024年3月21日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態の資金調達需要を背景に、0.075%程度での出会いが中心となった。金融政策の変更を受けてレート水準は大幅に上昇する展開となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.055~+0.040%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>

21日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。金融政策の変更を受けて、発行レートは0.1%以上に上昇し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

2024/3/21	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	0.040	0.130	0.074				-	▲ 0.101
T/N							-	0.029
S/N							-	-
1W	0.130	0.160	0.143				-	0.012
2W			0.190				-	▲ 0.016
3W							-	0.004
1M	0.120	0.580	0.157				-	0.019
3M			0.150				▲ 0.010	0.044
6M							0.050	0.074
1Y							0.090	0.104

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)	
0.740	+0.015	40,815.66	+812.06	150.72-74	151.22-24	
日付	3/13	3/14	3/15	3/18	3/19	
日銀当預残	5,298,500	5,303,100	5,309,600	5,392,200	5,434,800	
準備預金残	4,637,200	4,635,400	4,636,200	4,714,000	4,749,400	
マネタリーベース	6,555,700	6,560,600	6,566,200	6,648,500	6,691,600	
無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.009%	▲0.005%	▲0.003%	▲0.001%	
コール市場残高	196,868	202,387	164,112	158,272	190,330	
うち無担	168,243	173,895	136,502	129,991	163,636	
うちO/N	90,650	98,952	80,169	78,228	115,523	
うち有担	28,625	28,492	27,610	28,281	26,694	

●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)
流動性供給	401	-	5,000	2024/3/22	-	14,466	4,996		0.006%	25.6842%		▲0.001%	

●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*	応募総額(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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/21	2024/3/22	▲0.250	57,651	57,651		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/21	2024/3/22	▲0.250	0	0				

●2024年3月22日の予定

*月例経済報告
*2月の全国消費者物価指数(CPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.8%)

*国庫短期証券(1221回)入札
(3ヶ月、58,000億円、3/25発行)

◆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自身でなされたいと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