

Central Daily Market Report

2024年3月22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22日 需給速報	2024年3月25日 需給予想	2024年3月26日 当社予想
銀行券	200	400	500
財政	▲ 8,400	50,300	15,000
資金過不足	▲ 8,200	50,700	15,500

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			14,100			
CP等買入		▲ 300		▲ 400		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 50,100	57,200		50,100		
当預増減	▲ 1,400		114,500			15,500

当座預金残高	5,466,600	5,581,100	5,596,600	
準備預金残高	4,814,200			
積み終了先	4,811,700			
超過準備	4,808,900			
非準備預金先	652,400			
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	99.78%	日数	29.03%

●2024年3月22日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、引き続き付利金利との裁定を目的とした資金調達需要が強く、0.075~0.078%程度での出合いが中心となった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.020~+0.020%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>

22日はTB3M物(第1221回)の入札が実施され、強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでも、強含みで推移した。
この他、1Y物でも出合いが見られた。

<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

2024/3/22	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	0.045	0.125	0.077				-	▲ 0.024
T/N							-	0.004
S/N							-	-
1W							-	▲ 0.028
2W							-	▲ 0.035
3W			0.180				-	▲ 0.007
1M			0.280				-	0.008
3M							▲ 0.040	0.043
6M							0.035	0.075
1Y							0.085	0.106

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	0.000	40,888.43	+72.77	151.61-63	151.39-41
日付	3/14	3/15	3/18	3/19	3/21
日銀当預残	5,303,100	5,309,600	5,392,200	5,434,800	5,468,000
準備預金残	4,635,400	4,636,200	4,714,000	4,749,400	4,798,000
マネタリーベース	6,560,600	6,566,200	6,648,500	6,691,600	6,725,300
無担O/N加重平均	▲0.009%	▲0.005%	▲0.003%	▲0.001%	0.074%
コール市場残高	202,387	164,112	158,272	190,330	124,121
うち無担	173,895	136,502	129,991	163,636	94,535
うちO/N	98,952	80,169	78,228	115,523	51,372
うち有担	28,492	27,610	28,281	26,694	29,586

●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)
国庫短期証券	1221	-	58,000	2024/3/25	2024/7/1	187,323	46,941.4	100.0000	0.0000%	69.9724%	100.0039	▲0.0145%	11,058

●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	2024/3/25			9,155	3,752	0.010		0.012	6.0
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/3/25			9,394	4,255	0.012		0.014	38.2
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/3/25			7,308	4,756	0.003		0.006	28.3
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/3/25			2,855	1,503	0.012		0.016	58.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/22	2024/3/25	▲0.250	50,658	50,658		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/22	2024/3/25	▲0.250	128	128		▲0.250	▲0.250	

●2024年3月25日の予定

*金融政策決定会合議事要旨(1月22・23日分)	*2月の米新築一戸建て販売件数	*流動性供給入札(5,000億円、3/26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