

# Central Daily Market Report

2024年3月25日(月)

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25日 需給速報	2024年3月26日 需給予想	2024年3月27日 当社予想
銀行券	400	100	500
財政	51,100	23,600	▲ 3,000
資金過不足	51,500	23,700	▲ 2,500

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		▲ 400		▲ 600		
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	▲ 43,700	50,100		43,700		

当預増減	71,600	66,800	▲ 2,500
------	--------	--------	---------

当座預金残高	5,538,200	5,605,000	5,602,500
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,875,500		
積み終了先	4,873,900	3月26日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,872,600	積数	6.100
非準備預金先	662,700	1日平均	300

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	99.85%	日数	32.26%
---------	----	--------	----	--------

## ●2024年3月25日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担保コールO/N物は、引き続き邦銀業態を中心に資金調達需要が強く、0.075~0.078%程度での出会いが多く見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0~+0.03%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>

25日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の入札が実施された。発行レートは引き続き0.1%以上となるものが多く、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

2024/3/25	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考値 平均値
O/N	0.050	0.078	0.077				-	0.007
T/N							-	0.000
S/N							-	-
1W			0.100				-	▲ 0.040
2W			0.180				-	▲ 0.023
3W							-	▲ 0.007
1M							-	0.004
3M							▲ 0.060	0.042
6M							0.035	0.074
1Y							0.080	0.103

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)
0.730	▲ 0.010	40,414.12	▲ 474.31	151.29-32	151.32-33
日付	3/15	3/18	3/19	3/21	3/22
日銀当預残	5,309,600	5,392,200	5,434,800	5,468,000	5,466,600
準備預金残	4,636,200	4,714,000	4,749,400	4,798,000	4,814,400
マネタリーベース	6,566,200	6,648,500	6,691,600	6,725,300	6,723,700
無担O/N加重平均	▲ 0.005%	▲ 0.003%	▲ 0.001%	0.074%	0.077%
コール市場残高	164,112	158,272	190,330	124,121	124,842
うち無担	136,502	129,991	163,636	94,535	92,690
うちO/N	80,169	78,228	115,523	51,372	51,657
うち有担	27,610	28,281	26,694	29,586	32,152

## ●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1非価格競争入札(億円)
流動性供給	402	-	5,000	2024/3/26	-	18,487	4,991		▲ 0.017%	48.6735%		▲ 0.019%	

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/25	2024/3/26	▲ 0.250	44,208	44,208		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/25	2024/3/26	▲ 0.250	0	0				

## ●2024年3月26日の予定

*2月の企業向けサービス価格指数	*2月の米耐久財新規受注 *1月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数 *3月の米CB消費者信頼感指数
------------------	--

◆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