

Central Daily Market Report

2024年3月26日(火)

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26日 需給速報	2024年3月27日 需給予想	2024年3月28日 当社予想
銀行券	100	▲ 200	▲ 500
財政	20,800	21,500	▲ 1,000
資金過不足	20,900	21,300	▲ 1,500

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						
CP等買入		▲ 600		▲ 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						
気候変動対応オペ						
ETF買入						
国債補充供給	▲ 36,900	43,700		36,900		
当預増減	27,100		57,900		▲ 1,500	

当座預金残高	5,565,300	5,623,200	5,621,700
準備預金残高	4,911,900		
積み終了先	4,910,400		
超過準備	4,910,300		
非準備預金先	653,400		
3月27日以降の残り所要積立額			
積数			4,500
1日平均			200

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 99.89% 日数 35.48%

●短期金融市場関連指標

2024/3/26 単位: %	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	0.055	0.078	0.077				-	0.028
T/N							-	0.025
S/N							-	-
1W							-	▲ 0.013
2W							-	▲ 0.002
3W							-	0.007
1M							-	0.019
3M							▲ 0.060	0.043
6M							0.039	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)
0.735	+0.005	40,398.03	▲ 16.09	151.37-39	151.32-34
日付	3/18	3/19	3/21	3/22	3/25
日銀当預残	5,392,200	5,434,800	5,468,000	5,466,600	5,538,200
準備預金残	4,714,000	4,749,400	4,798,000	4,814,400	4,873,200
マネタリーベース	6,648,500	6,691,600	6,725,300	6,723,700	6,794,900
無担O/N加重平均	▲ 0.003%	▲ 0.001%	0.074%	0.077%	0.077%
コール市場残高	158,272	190,330	124,121	124,842	126,278
うち無担	129,991	163,636	94,535	92,690	95,496
うちO/N	78,228	115,523	51,372	51,657	54,463
うち有担	28,281	26,694	29,586	32,152	30,782

●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
米ドル資金供給		2024/3/28	2024/4/4	5.580	0	0				
CP等買入	4,000	2024/3/29			5,845	3,996	0.080		0.124	3.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/26	2024/3/27	▲ 0.250	37,313	37,313		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/26	2024/3/27	▲ 0.250	40	40		▲ 0.250	▲ 0.250	

●2024年3月27日の予定

*青森県金融経済懇談会において田村日銀審議委員講演

*40年利付国債入札(7,000億円、3/28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ものがあります。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