

Central Daily Market Report

2024年3月27日(水)

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27日 需給速報	2024年3月28日 需給予想	2024年3月29日 当社予想	
銀行券	▲ 200	▲ 100	▲ 500	
財政	15,100	8,900	39,000	
資金過不足	14,900	8,800	38,500	
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				
国債売現				
国庫短期証買入				
国債買入				
CP等買入		▲ 300	▲ 300	4,000
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	▲ 36,200	36,900		36,200
当預増減	15,300	44,700		42,500
当座預金残高	5,580,600	5,625,300		5,667,800
準備預金残高	4,923,600			
積み終了先	4,922,100			
超過準備	4,922,100			
非準備預金先	657,000			
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	99.93%	日数	38.71%

●2024年3月27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ニーズが強く、0.075~0.078%程度で多くの出会いが見られた。ターム物では、0.13~0.17%程度で出会いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、+0.01~+0.08%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>

27日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、3M物に出会いが見られた。

<CP市場>

CP市場は月末発行にあたり、幅広い業態から発行が実施された。発行レートは、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られるが、総じて0.1%以上での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2024/3/27	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				-	0.006
T/N							-	0.010
S/N							-	-
1W							-	▲ 0.017
2W							-	0.003
3W							-	0.011
1M			0.150				-	0.022
3M	0.155	0.280	0.235				▲ 0.060	0.043
6M							0.040	0.074
1Y							0.078	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)
0.715	▲ 0.020	40,762.73	+364.70	151.52-54	151.70-72
日付	3/19	3/21	3/22	3/25	3/26
日銀当預残	5,434,800	5,468,000	5,466,600	5,538,200	5,565,300
準備預金残	4,749,400	4,798,000	4,814,400	4,873,200	4,911,900
マネタリーベース	6,691,600	6,725,300	6,723,700	6,794,900	6,821,900
無担O/N加重平均	▲ 0.001%	0.074%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	190,330	124,121	124,842	126,278	124,954
うち無担	163,636	94,535	92,690	95,496	91,145
うちO/N	115,523	51,372	51,657	54,463	50,372
うち有担	26,694	29,586	32,152	30,782	33,809

●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I非価格競争入札(億円)
40年利付国債	16	1.3%	7,000	2024/3/28	2063/3/20	17,400	6,997	83.41	1.905%	47.4137%			

●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)		2024/3/27	2024/3/28	▲ 0.250	36,626	36,626		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/27	2024/3/28	▲ 0.250	0	0				

●2024年3月28日の予定

*決定会合における主な意見(3月18、19日分)

*10-12月期の米GDP確報値
*3月のシカゴPM景況感指数
*10-12月期の英GDP確報値

◆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