

Central Daily Market Report

2024年3月29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29日 需給速報	2024年4月1日 需給予想	2024年4月2日 当社予想
銀行券	800	600	1,200
財政	27,100	▲ 15,400	▲ 5,000
資金過不足	27,900	▲ 14,800	▲ 3,800

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	11,300					
CP等買入	4,000	▲ 7,700				
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						
国債補充供給	▲ 42,600	36,600		42,600		

当増減	29.500	27.800	▲ 3.800
-----	--------	--------	---------

当座預金残高	5,611,900	5,639,700	5,635,900	
準備預金残高	4,942,800			
積み終了先	4,942,800		4月1日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,942,600		積数	300
非準備預金先	669,100		1日平均	0

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	99.99%	日数	51.61%
---------	----	--------	----	--------

●2024年3月29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いものの、年度末要因によりビッド件数が減少した事を受け、レート水準も若干低下し、0.073~0.077%程度での出合いとなった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.01~0.015%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>

29日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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。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

2024/3/29	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	売買参考統計値	平均値
単位:%								
O/N	0.040	0.078	0.074				-	▲ 0.029
T/N							-	0.010
S/N							-	-
1W							-	0.013
2W							-	0.018
3W							-	0.028
1M							-	0.033
3M							▲ 0.060	0.049
6M							0.040	0.074
1Y							0.090	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)		
0.725	+0.020	40,369.44	+201.37	151.43-46	151.33-34		

日付	3/22	3/25	3/26	3/27	3/28
日銀当預残	5,466,600	5,538,200	5,565,300	5,580,600	5,582,400
準備預金残	4,814,400	4,873,200	4,911,900	4,922,800	4,917,000
マネタリーベース	6,723,700	6,794,900	6,821,900	6,837,400	6,839,300
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	124,842	126,278	124,954	120,541	119,910
うち無担	92,690	95,496	91,145	86,911	85,509
うちO/N	51,657	54,463	50,372	46,548	46,706
うち有担	32,152	30,782	33,809	33,630	34,401

●入札結果

名称	回数	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)
2年利付国債	459	0.2%	26,000	2024/4/1	2026/4/1	85,834	21,079	100.015	0.192%	26.2089%	100.024	0.187%	4,913

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/29	2024/4/1	▲0.250	43,016	43,016		▲0.250	▲0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/29	2024/4/1	▲0.250	0	0				

●2024年4月1日の予定

*3月調査の日銀短観(概要及び要旨)

*3月のISM製造業景況指数

*2月の米建設支出

*EURO、London祝日(Easter Monday)

◆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場合があります。金融商品取引法に基づきお預り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