

Central Daily Market Report

2024年3月18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18日 需給速報	2024年3月19日 需給予想	2024年3月21日 当社予想
銀行券	300	▲ 600	▲ 500
財政	18,700	6,200	78,000
資金過不足	19,000	5,600	77,500

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			23,500	▲ 8,300		
国債買現			28,500			▲ 30,000
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	13,400					
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)	98,500	▲ 45,900				
被災地支援						
社債等買入		▲ 100	▲ 100	1,000		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 34,400	32,100	34,400			

当増減	82,600	83,600	48,500
-----	--------	--------	--------

当座預金残高	5,392,200	5,475,800	5,524,300
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,713,900		
積み終了先	4,696,400	3月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,655,400	積数	68,800
非準備預金先	678,300	1日平均	2,500

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	98.30%	日数	9.68%
---------	----	--------	----	-------

●2024年3月18日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、新しい積み期間となったが、引き続き邦銀勢を中心に調達意欲が非常に強く、▲0.003~▲0.001%程度での出会いとなった。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.105~▲0.06%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>

18日はTB1Y物(第1220回)の入札が実施され、+0.10%を上回る利回りでの決着となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<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、前営業日比で概ね横ばい圏で推移した。

●短期金融市場関連指標

2024/3/18	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	▲0.087	0.001	▲0.003				-	▲0.085
T/N							-	▲0.083
S/N							-	-
1W							-	▲0.029
2W							-	▲0.023
3W							-	▲0.011
1M							-	▲0.001
3M							0.005	0.033
6M							0.059	0.059
1Y							0.095	0.089

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)
0.755	▲0.030	39,740.44	+1032.80	148.95-97	149.12-14
日付	3/11	3/12	3/13	3/14	3/15
日銀当預残	5,310,800	5,317,600	5,298,500	5,303,100	5,309,600
準備預金残	4,651,400	4,647,000	4,637,200	4,635,400	4,636,200
マネタリーベース	6,568,700	6,575,300	6,555,700	6,560,600	6,566,200
無担O/N加重平均	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.009%	▲0.005%
コール市場残高	215,387	216,395	196,868	202,387	164,112
うち無担	186,818	188,064	168,243	173,895	136,502
うちO/N	106,070	107,521	90,650	98,952	80,169
うち有担	28,569	28,331	28,625	28,492	27,610

●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	1220	-	35,000	2024/3/21	2025/3/21	117,248	29,406	99.877	0.1231%	1.0000%	99.895	0.1051%	5,594

●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*	応募総額(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
国債買現先	30,000	2024/3/19	2024/3/21		34,000	30,004	▲0.100		▲0.098	85.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/18	2024/3/19	▲0.350	34,955	34,955		▲0.350	▲0.350	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2024/3/19	2024/4/3	0.000	23,469	23,469				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/18	2024/3/19	▲0.350	0	0				

●2024年3月19日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後、直ちに結果公表)	*米FOMC(1日目)
*日銀総裁定例会見	*2月の米住宅着工件数

◆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