

# Central Daily Market Report

2024年3月28日(木)

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28日 需給速報	2024年3月29日 需給予想	2024年4月1日 当社予想
銀行券	▲ 100	800	▲ 100
財政	2,600	28,700	▲ 16,000
資金過不足	2,500	29,500	▲ 16,100

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		▲ 300	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	▲ 36,600	36,200		36,600		
当預増減	1,800		73,700		▲ 16,100	

当座預金残高	5,582,400	5,656,100	5,640,000	
準備預金残高	4,918,500			
積み終了先	4,918,200			
超過準備	4,916,600			
非準備預金先	663,900			
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	99.98%	日数	41.94%

## ●2024年3月28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。ターム物は、0.13~0.17%程度で引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.05~+0.02%程度での出会いとなった。  
SCI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>

28日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物に出会いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、複数の業態で大型発行が実施された。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

2024/3/28	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
O/N	0.055	0.078	0.077				-	0.029
T/N							-	0.005
S/N							-	-
1W							-	▲ 0.001
2W							-	0.011
3W							-	0.017
1M							-	0.028
3M							▲ 0.060	0.045
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)
0.705	▲ 0.010	40,168.07	▲ 594.66	151.27-29	151.43-45
日付	3/21	3/22	3/25	3/26	3/27
日銀当預残	5,468,000	5,466,600	5,538,200	5,565,300	5,580,600
準備預金残	4,798,000	4,814,400	4,873,200	4,911,900	4,922,800
マネタリーベース	6,725,300	6,723,700	6,794,900	6,821,900	6,837,400
無担O/N加重平均	0.074%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	124,121	124,842	126,278	124,954	120,541
うち無担	94,535	92,690	95,496	91,145	86,911
うちO/N	51,372	51,657	54,463	50,372	46,548
うち有担	29,586	32,152	30,782	33,809	33,630

## ●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/3/29			6,070	4,252	▲0.013		▲0.008	58.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/3/29			7,070	4,754	▲0.008		▲0.006	82.4
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/3/29			3,800	1,505	▲0.012		▲0.008	18.9
国債買入(物価連動債)	600	2024/3/29			2,306	600		▲0.310	▲0.335	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/3/28	2024/3/29	▲0.250	37,102	37,102		▲0.250	▲0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/3/28	2024/3/29	▲0.250	1	1		▲0.250	▲0.250	

## ●2024年3月29日の予定

*3月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.4%)	*2月の米個人所得・消費支出(PCE)	*2年利付国債入札 (26,000億円、4/1発行)
*2月の完全失業率(市場予想:2.4%)		
*2月の有効求人倍率(市場予想:1.27倍)		
*2月の商業動態統計速報		
*2月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+1.4%)		
*2月の住宅着工統計		

◆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