

# Central Daily Market Report

2024年3月14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14日 需給速報	2024年3月15日 需給予想	2024年3月18日 当社予想		
銀行券	▲ 300	900	200		
財政	8,000	8,400	▲ 2,000		
資金過不足	7,700	9,300	▲ 1,800		
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		▲ 200	▲ 500		
貸出支援基金(成)					
貸出支援基金(貸)			98,500	▲ 41,500	
被災地支援					
社債等買入		▲ 100	▲ 500		
気候変動対応オペ					
E T F 買入					
国債補完供給	▲ 33,600	30,700	33,600		
当預増減	4,500	41,900	55,200		
当座預金残高	5,303,000	5,344,900	5,400,100		
準備預金残高	4,636,000				
積み終了先	4,636,000			3月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,635,900			積数	0
非準備預金先	667,000			1日平均	0
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額					3,772,700
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数		96.55%

## ●2024年3月14日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、国内勢を中心に▲0.008~▲0.005%近辺で出合いが見られた。積み最終日を明日に控えるなか、市場の運用額がやや減少傾向にある事もあり、出合い水準は前日比で若干上昇する展開となった。ターム物はショートタームでの引き合いが散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、▲0.09~▲0.085%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>

14日のアウトライイト市場は動意なく閑散なか、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、前日比で概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2024/3/14	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	▲ 0.009				-	▲ 0.098
T/N			▲ 0.001				-	▲ 0.088
S/N							-	-
1W			▲ 0.005				-	▲ 0.069
2W							-	▲ 0.060
3W							-	▲ 0.055
1M							-	▲ 0.040
3M							▲ 0.040	0.000
6M							0.010	0.030
1Y							0.025	0.057

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)
0.775	+0.020	38,807.38	+111.41	147.59-61	147.86-88
日付	3/7	3/8	3/11	3/12	3/13
日銀当預残	5,297,100	5,301,900	5,310,800	5,317,600	5,298,500
準備預金残	4,648,300	4,648,400	4,651,400	4,647,000	4,637,200
マネタリーベース	6,556,100	6,560,300	6,568,700	6,575,300	6,555,700
無担O/N加重平均	▲0.011%	▲0.010%	▲0.010%	▲0.011%	▲0.011%
コール市場残高	217,330	215,765	215,387	216,395	196,868
うち無担	188,127	185,777	186,818	188,064	168,243
うちO/N	108,814	106,319	106,070	107,521	90,650
うち有担	29,203	29,988	28,569	28,331	28,625

## ●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1非価格競争入札(億円)
20年利付国債	187	1.3%	10,000	2024/3/15	2043/12/20	24,194	8,047	95.70	1.585%	8.4788%	96.08	1.559%	1,949

## ●オペ結果

種類	オフター額(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(午前オフター分)		2024/3/14	2024/3/15	▲0.350	33,954	33,954		▲0.350	▲0.350	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オフター分)		2024/3/14	2024/3/15	▲0.350	0	0				
種類	スタート日	エンド日	貸付利率	貸付予定総額(億円)						
貸出増加支援オペ	貸付期間4年(新規貸付)	2024/3/18	2028/3/17	0	98,510					

## ●2024年3月15日の予定

*1月の第3次産業活動指数	*2月の米鉱工業生産・設備稼働率	*国庫短期証券(1219回)入札
	*3月のミシガン大消費者信頼感指数速報	(3ヶ月、58,000億円、3/18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ものがあります。金融商品取引申請に基づきお渡しする書面や目論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