

# Central Daily Market Report

2024年4月2日(火)

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4月2日 需給速報	2024年4月3日 需給予想	2024年4月4日 当社予想			
銀行券	200	200	800			
財政	▲ 15,400	▲ 10,700	▲ 1,000			
資金過不足	▲ 15,200	▲ 10,500	▲ 200			
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		8,000	▲ 23,500			
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入			▲ 100			
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	▲ 42,900	44,400	42,900			
当増増減	▲ 13,700	16,800	▲ 200			
当座預金残高	5,582,400	5,599,200	5,599,000			
準備預金残高	4,900,600					
積み終了先	4,900,500			4月3日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,900,500			積数	200	
非準備預金先	681,800			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	100.00%	日数	58.06%		

## ●2024年4月2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、出会い水準は0.075~0.078%程度で推移した。ターム物は0.20%近辺で引き合いが見られた。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.005~0.01%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>

2日のアウトライト市場は閑散な中、特段の出会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。引き続き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ものの、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

2024/4/2	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
単位：%								
O/N	0.060	0.078	0.077				-	0.008
T/N							-	0.009
S/N							-	-
1W							-	0.017
2W							-	0.023
3W	0.140	0.170	0.160				-	0.027
1M			0.200				-	0.033
3M	0.200	0.280	0.271				▲ 0.050	0.051
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)
0.765	+0.025	39,838.91	+35.82	151.58-60	151.67-69
日付	3/26	3/27	3/28	3/29	4/1
日銀当預残	5,565,300	5,580,600	5,582,400	5,611,900	5,596,100
準備預金残	4,911,900	4,922,800	4,917,000	4,942,800	4,910,300
マネタリーベース	6,821,900	6,837,400	6,839,300	6,867,900	6,851,500
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.074%	0.077%
コール市場残高	124,954	120,541	119,910	121,665	114,927
うち無担	91,145	86,911	85,509	94,421	84,914
うちO/N	50,372	46,548	46,706	64,568	51,621
うち有担	33,809	33,630	34,401	27,244	30,013

## ●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1非償格募入札(億円)	非競争入札(億円)
10年利付国債	374	0.8%	26,000	2024/4/3	2034/3/20	79,427	20,908	100.41	0.755%	52.7215%	100.43	0.753%	5,079	8.12

## ●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
米ドル資金供給		2024/4/4	2024/4/11	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/2	2024/4/3	▲0.250	43,404	43,404		▲0.250	▲0.250	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/4/3	2024/4/17	0.100	8,125	8,005				98.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/2	2024/4/3	▲0.250	0	0				

## ●2024年4月3日の予定

*4月の日銀当座預金増減要因見込み	*3月のISM非製造業景況指数 *3月のユーロ圏消費者物価指数速報値	*国庫短期証券(1222回)入札 (3ヶ月、58,000億円、4/4発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、4/11借入)
-------------------	---------------------------------------	---

◆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よう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