

# Central Daily Market Report

2024年4月4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4月4日 需給速報	2024年4月5日 需給予想	2024年4月8日 当社予想
銀行券	400	700	▲ 500
財政	3,000	600	▲ 2,000
資金過不足	3,400	1,300	▲ 2,500

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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	10,900					
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	▲ 38,300	38,100		38,300		
当預増減	14,100		39,500		▲ 2,500	

当座預金残高	5,570,000	5,609,500	5,607,000	
準備預金残高	4,907,400			
積み終了先	4,907,400			
超過準備	4,907,400			
非準備預金先	662,600			
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	64.52%

## ●2024年4月4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。ターム物は目立った出会いがなく閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.03~0.045%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>

4日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、入札件数が少なく閑散であった。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ものの、総じて0.1%以上の推移となった。

## ●短期金融市場関連指標

2024/4/4	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	売買参考計値	平均値
O/N	0.060	0.078	0.077				-	0.036
T/N							-	0.045
S/N							-	-
1W							-	0.030
2W							-	0.029
3W							-	0.031
1M							-	0.036
3M	0.170	0.270	0.189				0.004	0.053
6M							0.040	0.075
1Y							0.090	0.104

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	+0.010	39,773.14	+321.29	151.58-60	151.68-70
日付	3/28	3/29	4/1	4/2	4/3
日銀当預残	5,582,400	5,611,900	5,596,100	5,582,400	5,555,900
準備預金残	4,917,000	4,942,800	4,910,300	4,900,600	4,880,500
マネタリーベース	6,839,300	6,867,900	6,851,500	6,837,600	6,810,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.074%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	119,910	121,665	114,927	111,170	120,970
うち無担	85,509	94,421	84,914	79,915	87,911
うちO/N	46,706	64,568	51,621	44,647	51,618
うち有担	34,401	27,244	30,013	31,255	33,059

## ●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I非価格競争入札(億円)
30年利付国債	82	1.8%	9,000	2024/4/5	2054/3/20	25,129	7,248	99.70	1.815%	44.5534%	99.83	1.808%	1,747

## ●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/4	2024/4/5	▲0.250	38,698	38,698		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/4	2024/4/5	▲0.250	0	0				

## ●2024年4月5日の予定

*3月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*3月の米雇用統計	*国庫短期証券(1223回)入札(3ヶ月、58,000億円、4/8発行)
*2月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲3.0%)	*2月の米消費者信用残高	*交付税特別会計借入(13,000億円、4/15借入)
*2月の景気動向指数速報		

◆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