

Central Daily Market Report

2024年4月5日(金)

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5日 需給速報	2024年4月8日 需給予想	2024年4月9日 当社予想
銀行券	800	900	▲ 100
財政	5,400	▲ 5,300	1,000
資金過不足	6,200	▲ 4,400	900

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						
CP等買入		▲ 100		▲ 500		
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	▲ 36,400	38,300		36,400		

当預増減	8,000	31,500	900
------	-------	--------	-----

当座預金残高	5,578,000	5,609,500	5,610,400
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,917,800			
積み終了先	4,917,700		4月8日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,917,700		積数	100
非準備預金先	660,200		1日平均	0

積み期間(3/16~4/15)の所要準備額	4,056,600
-----------------------	-----------

準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	74.19%
---------	----	---------	----	--------

●2024年4月5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、週末3日積み要因も相まって、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、出合い水準は0.075~0.078%程度で推移した。
ターム物は目立った出合いがなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.055~0.065%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>

5日はTB3M物(第1223回)の入札が実施され、しっかりとした結果となった。
結果発表後のセカンダリーでも堅調に推移した。

<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%以上での推移となった。

●短期金融市場関連指標

2024/4/5	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	0.060	0.078	0.077					-	0.048
T/N								-	0.054
S/N								-	-
1W								-	0.039
2W								-	0.037
3W								-	0.037
1M			0.150					-	0.036
3M			0.190					▲ 0.001	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)		
0.765	▲ 0.010	38,992.08	▲ 781.06	151.29-31	151.33-35		
日付	3/29	4/1	4/2	4/3	4/4		
日銀当預残	5,611,900	5,596,100	5,582,400	5,555,900	5,570,000		
準備預金残	4,942,800	4,910,300	4,900,600	4,880,500	4,905,900		
マネタリーベース	6,867,900	6,851,500	6,837,600	6,810,900	6,824,600		
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	121,665	114,927	111,170	120,970	124,625		
うち無担	94,421	84,914	79,915	87,911	88,933		
うちO/N	64,568	51,621	44,647	51,618	51,510		
うち有担	27,244	30,013	31,255	33,059	35,692		

●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)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1223	-	58,000	2024/4/8	2024/7/16	168,039	46,682.1	99.9970	0.0110%	4.7216%	99.9987	0.0047%	11,317	
交付税特会	-	-	13,000	2024/4/15	2024/10/17	80,815	12,990		0.110%	42.9239%		0.107%		10

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/5	2024/4/8	▲0.250	36,829	36,829		▲0.250	▲0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/5	2024/4/8	▲0.250	0	0				

●2024年4月8日の予定

- *2月の国際収支
- *2月の毎月勤労統計調査速報
- *3月の景気ウォッチャー調査

◆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