

# Central Daily Market Report

2024年4月9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9日 需給速報	2024年4月10日 需給予想	2024年4月11日 当社予想
銀行券	700	0	600
財政	9,800	▲ 25,200	1,000
資金過不足	10,500	▲ 25,200	1,600

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	9,200					
CP等買入				▲ 400		
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	▲ 36,900	42,100		36,900		
当預増減	24,900		11,300			1,600

当座預金残高	5,595,400	5,606,700	5,608,300	
準備預金残高	4,924,500			
積み終了先	4,924,500		4月10日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,924,500		積数	0
非準備預金先	670,900		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	80.65%

## ●短期金融市場関連指標

2024/4/9	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	0.060	0.078	0.077				-	0.017
T/N							-	0.032
S/N							-	-
1W			0.180				-	0.037
2W							-	0.034
3W							-	0.035
1M			0.200				-	0.034
3M							▲ 0.001	0.052
6M							0.025	0.074
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)
0.780	▲ 0.005	39,773.13	+426.09	151.83-84	151.90-91
日付	4/2	4/3	4/4	4/5	4/8
日銀当預残	5,582,400	5,555,900	5,570,000	5,578,000	5,570,500
準備預金残	4,900,600	4,880,500	4,905,900	4,910,600	4,900,800
マネタリーベース	6,837,600	6,810,900	6,824,600	6,831,800	6,823,300
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	111,170	120,970	124,625	120,075	119,262
うち無担	79,915	87,911	88,933	86,466	84,252
うちO/N	44,647	51,618	51,510	48,723	46,609
うち有担	31,255	33,059	35,692	33,609	35,010

## ●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1224	-	40,000	2024/4/10	2024/10/10	136,320	32,459.8	99.978	0.0438%	42.5054%	99.979	0.0418%	7,540
5年利付国債	167	0.4%	23,000	2024/4/10	2029/3/20	73,083	18,847	99.96	0.408%	30.1747%	99.98	0.404%	4,148
エネルギー対策	-	-	8,144	2024/4/22	2025/4/21	45,005	8,144		0.195%	82.3920%		0.181%	

## ●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		2024/4/11	2024/4/18	5.580	0	0				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/9	2024/4/10	▲ 0.250	37,394	37,394		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/9	2024/4/10	▲ 0.250	0	0				

## ●2024年4月10日の予定

\*3月の企業物価指数

\*2月の特定サービス産業動態統計速報

\*3月の米消費者物価指数

\*2月の米卸売売上高

\*3月の米財政収支

◆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