

Central Daily Market Report

2024年4月10日(水)
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10日 需給速報	2024年4月11日 需給予想	2024年4月12日 当社予想		
銀行券	0	100	▲ 500		
財政	▲ 12,400	▲ 1,800	▲ 7,000		
資金過不足	▲ 12,400	▲ 1,700	▲ 7,500		
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		▲ 400	▲ 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			▲ 100		
気候変動対応オペ					
E T F 買入					
国債補完供給	▲ 35,800	36,900	35,800		
当預増減	▲ 11,700	33,900	▲ 7,500		
当座預金残高	5,583,700	5,617,600	5,610,100		
準備預金残高	4,921,300				
積み終了先	4,921,200			4月11日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,921,200			積数	0
非準備預金先	662,400			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	83.87%	

●2024年4月10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、出合い水準は0.075~0.078%程度で推移した。ターム物は1M~3Mで0.20%近辺で引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.03~0.06%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＞

10日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、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0.1%以上で推移し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

また、CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は按分レート0.100%、平均レート0.129%と前回(按分0.080%、平均0.124%)比で、按分、平均ともに上昇した。

●短期金融市場関連指標

2024/4/10	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	0.060	0.078	0.077				-	0.061
T/N							-	0.048
S/N							-	-
1W							-	0.039
2W							-	0.038
3W							-	0.038
1M							-	0.037
3M			0.200				▲ 0.001	0.050
6M							0.025	0.077
1Y							0.090	0.107

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)
0.795	+0.015	39,581.81	▲ 191.32	151.77-78	151.84-85
日付	4/3	4/4	4/5	4/8	4/9
日銀当預残	5,555,900	5,570,000	5,578,000	5,570,500	5,595,400
準備預金残	4,880,500	4,905,900	4,910,600	4,900,800	4,919,300
マネタリーベース	6,810,900	6,824,600	6,831,800	6,823,300	6,847,600
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	120,970	124,625	120,075	119,262	114,092
うち無担	87,911	88,933	86,466	84,252	83,141
うちO/N	51,618	51,510	48,723	46,609	44,948
うち有担	33,059	35,692	33,609	35,010	30,951

●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	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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
CP等買入	4,000	2024/4/15			9,162	3,985	0.100		0.129	6.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/10	2024/4/11	▲ 0.250	36,277	36,277		▲ 0.250	▲ 0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/10	2024/4/11	▲ 0.250	0	0				

●2024年4月11日の予定

*3月のマネーストック	*ECB定例理事会 *3月の米生産者物価指数	*20年利付国債入札 (10,000億円、4/12発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、4/24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