

# Central Daily Market Report

2024年4月11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11日 需給速報	2024年4月12日 需給予想	2024年4月15日 当社予想
銀行券	0	300	1,000
財政	2,300	▲ 4,000	84,000
資金過不足	2,300	▲ 3,700	85,000

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		▲ 400		4,000
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		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 35,300	35,800		35,300		

当預増減	2,600	31,100	89,000
------	-------	--------	--------

当座預金残高	5,586,300	5,617,400	5,706,400
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,908,800		
積み終了先	4,908,800	4月12日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,908,800	積数	0
非準備預金先	677,500	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	87.10%
---------	----	---------	----	--------

## ●2024年4月11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0.074~0.078%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、0.04~0.07%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>

11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、五・十日発行にあたり、複数の業態から大型発行が見られた。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。

## ●短期金融市場関連指標

2024/4/11	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	売買参考値 平均値
O/N	0.060	0.078	0.077				-	0.051
T/N							-	0.055
S/N							-	-
1W							-	0.044
2W				0.170			-	0.043
3W				0.170			-	0.043
1M				0.190			-	0.040
3M				0.185			▲ 0.001	0.053
6M							0.025	0.077
1Y							0.090	0.108

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)
0.850	+0.055	39,442.63	▲ 139.18	152.94-96	153.12-14
日付	4/4	4/5	4/8	4/9	4/10
日銀当預残	5,570,000	5,578,000	5,570,500	5,595,400	5,583,700
準備預金残	4,905,900	4,910,600	4,900,800	4,919,300	4,919,000
マネタリーベース	6,824,600	6,831,800	6,823,300	6,847,600	6,835,800
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	124,625	120,075	119,262	114,092	121,405
うち無担	88,933	86,466	84,252	83,141	85,473
うちO/N	51,510	48,723	46,609	44,948	46,650
うち有担	35,692	33,609	35,010	30,951	35,932

## ●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)
20年利付国債	188	1.6%	10,000	2024/4/12	2044/3/20	24,818	8,149	99.15	1.656%	37.6859%	99.54	1.630%	1,846	
交付税特会	-	-	13,000	2024/4/24	2024/10/24	82,115	12,990.01		0.115%	50.8070%		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)		2024/4/11	2024/4/12	▲0.250	35,782	35,782		▲0.250	▲0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/11	2024/4/12	▲0.250	0	0				

## ●2024年4月12日の予定

\*4月のミシガン大消費者信頼感指数速報

\*国庫短期証券(1225回)入札  
(3ヶ月58,000億円、4/15発行)

◆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