

Central Daily Market Report

2024年4月12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12日 需給速報	2024年4月15日 需給予想	2024年4月16日 当社予想
銀行券	300	▲ 100	▲ 500
財政	▲ 500	85,500	1,000
資金過不足	▲ 200	85,400	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			12,900			
CP等買入		▲ 400	4,000	▲ 200		
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		▲ 700		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 33,200	35,300		33,200		

当預増減	1,400	134,600	500
------	-------	---------	-----

当座預金残高	5,587,700	5,722,300	5,722,800
--------	-----------	-----------	-----------

準備預金残高	4,910,800		
積み終了先	4,910,800	4月15日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,910,800	積数	0
非準備預金先	676,900	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	96.77%
---------	----	---------	----	--------

●2024年4月12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0.074~0.078%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、0.055~0.095%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>

12日はTB3M物(第1225回)の入札が実施され、無難な結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

<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。

●短期金融市場関連指標

2024/4/12	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	0.080	0.077				-	0.065
T/N							-	0.079
S/N							-	-
1W							-	0.053
2W							-	0.051
3W							-	0.051
1M							-	0.049
3M							0.000	0.055
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)		
0.860	+0.010	39,523.55	+80.92	153.19-21	153.24-25		
日付	4/5	4/8	4/9	4/10	4/11		
日銀当預残	5,578,000	5,570,500	5,595,400	5,583,700	5,586,300		
準備預金残	4,910,600	4,900,800	4,919,300	4,919,000	4,908,800		
マネタリーベース	6,831,800	6,823,300	6,847,600	6,835,800	6,838,400		
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	120,075	119,262	114,092	121,405	112,945		
うち無担	86,466	84,252	83,141	85,473	78,904		
うちO/N	48,723	46,609	44,948	46,650	39,901		
うち有担	33,609	35,010	30,951	35,932	34,041		

●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第1非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1225	-	58,000	2024/4/15	2024/7/22	144,369.6	46,931.6	99.9970	0.0111%	0.2039%	99.9989	0.0040%	11,068

●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/4/15			12,573	3,757	0.000		0.001	47.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/4/15			9,769	4,257	▲0.011		▲0.009	17.1
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/4/15			11,814	4,757	▲0.018		▲0.015	75.7
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/12	2024/4/15	▲0.150	33,886	33,886		▲0.150	▲0.150	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/12	2024/4/15	▲0.150	5	5		▲0.150	▲0.150	

●2024年4月15日の予定

*2月の機械受注統計(市場予想:電力除く民需、前月比+0.8%)

*3月の米小売売上高
*2月の米企業在庫

◆本資料は信頼できると思わ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