

Central Daily Market Report

2024年4月16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16日 需給速報	2024年4月17日 需給予想	2024年4月18日 当社予想
銀行券	200	▲ 700	▲ 1,000
財政	5,600	▲ 1,800	1,500
資金過不足	5,800	▲ 2,500	500
金融調節	スタート	スタート	スタート
貸出	スタート	スタート	スタート
全店共通		7,000	▲ 8,000
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入			
CP等買入		▲ 800	▲ 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	▲ 100
気候変動対応オペ			
E T F買入			
国債補充供給	▲ 35,900	35,200	35,900
当預増減	4,200	32,200	500
当座預金残高	5,689,800	5,722,000	5,722,500
準備預金残高	4,998,900		
積み終了先	3,682,700		4月17日以降の残り所要積立額
超過準備	1,505,500		積数 461,500
非準備預金先	690,900		1日平均 15,900
積み期間(4/16~5/15)の所要準備額			3,955,000
準備預金進捗率	実績 88.33%	日数 3.33%	

●2024年4月16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、積み期初日となったが前日比で大きな変化は無く、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0.077%を中心に0.070~0.078%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、0.03~0.05%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>

16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発行市場は複数の業態で発行が実施された。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

2024/4/16 単位: %	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	0.050	0.078	0.077				-	0.044
T/N							-	0.041
S/N							-	-
1W							-	0.046
2W							-	0.047
3W	0.120	0.160	0.130				-	0.045
1M	0.140	0.160	0.150				-	0.039
3M			0.180				0.010	0.050
6M							0.025	0.075
1Y							0.140	0.106

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)
0.865	+0.005	38,471.20	▲ 761.60	154.21-23	154.39-40
日付	4/9	4/10	4/11	4/12	4/15
日銀当預残	5,595,400	5,583,700	5,586,300	5,587,700	5,685,600
準備預金残	4,919,300	4,919,000	4,908,800	4,910,800	5,003,500
マネタリーベース	6,847,600	6,835,800	6,838,400	6,839,500	6,937,400
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	114,092	121,405	112,945	119,374	120,092
うち無担	83,141	85,473	78,904	82,883	82,969
うちO/N	44,948	46,650	39,901	44,030	44,116
うち有担	30,951	35,932	34,041	36,491	37,123

●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1非価格競争入札(億円)
流動性供給	403	-	6,000	2024/4/17	-	18,720	5,986		▲0.001%	89.4325%		▲0.001%	

●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
米ドル資金供給		2024/4/18	2024/4/25	5.580	1	1				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/16	2024/4/17	▲0.150	36,552	36,552		▲0.150	▲0.150	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/4/17	2024/5/1	0.100	7,020	7,020				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/16	2024/4/17	▲0.150	0	0				

●2024年4月17日の予定

*3月の貿易統計
*2月の石油等消費動態統計

*米ページブック
*3月のユーロ圏消費者物価指数改定値
*3月の英消費者物価指数

◆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