

# Central Daily Market Report

2024年4月17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17日 需給速報	2024年4月18日 需給予想	2024年4月19日 当社予想
銀行券	▲ 600	▲ 500	▲ 1,000
財政	▲ 17,200	10,900	▲ 5,000
資金過不足	▲ 17,800	10,400	▲ 6,000

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	7,000	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			14,100			
CP等買入		▲ 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	▲ 31,800	35,900		31,800		
当預増減	▲ 14,900		56,300		▲ 6,000	

当座預金残高	5,674,900	5,731,200	5,725,200	
準備預金残高	4,980,400			
積み終了先	4,900,700			
超過準備	4,598,800			
非準備預金先	694,500			
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	98.22%	日数	6.67%

## ●2024年4月17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、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、▲0.02~0.025%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>

17日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、3M物、1Y物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は、五・十日の前倒し発行にあたり、一部の業態で大型発行が実施された。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

2024/4/17	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				-	0.036
T/N			0.070				-	0.019
S/N							-	-
1W							-	0.032
2W	0.150	0.300	0.200				-	0.035
3W							-	0.037
1M							-	0.032
3M							0.010	0.051
6M							0.025	0.075
1Y							0.160	0.111

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)
0.885	+0.020	37,961.80	▲ 509.40	154.69-70	154.61-63
日付	4/10	4/11	4/12	4/15	4/16
日銀当預残	5,583,700	5,586,300	5,587,700	5,685,600	5,689,800
準備預金残	4,919,000	4,908,800	4,910,800	5,003,500	4,998,900
マネタリーベース	6,835,800	6,838,400	6,839,500	6,937,400	6,941,500
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	121,405	112,945	119,374	120,092	117,730
うち無担	85,473	78,904	82,883	82,969	79,520
うちO/N	46,650	39,901	44,030	44,116	41,067
うち有担	35,932	34,041	36,491	37,123	38,210

## ●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
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/4/18			6,817	3,754	0.000		0.004	7.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/4/18			6,859	4,257	0.000		0.003	52.7
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/4/18			17,068	4,757	0.005		0.006	70.1
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/4/18			4,373	1,503	0.021		0.022	82.0
社債等買入	1,000	2024/4/22			1,724	1,001	0.450		0.467	61.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/17	2024/4/18	▲0.250	32,253	32,253		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/17	2024/4/18	▲0.250	190	190		▲0.250	▲0.250	

## ●2024年4月18日の予定

*佐賀県金融経済懇談会において 野口日銀審議委員講演 *2月の第3次産業活動指数	*3月の米中古住宅販売	*国庫短期証券(1226回)入札 (1年、32,000億円、4/22発行) *流動性供給入札 (5,000億円、4/19発行)
--	-------------	--

◆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