

Central Daily Market Report

2024年4月18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18日 需給速報	2024年4月19日 需給予想	2024年4月22日 当社予想		
銀行券	▲ 500	▲ 300	▲ 1,000		
財政	12,900	10,800	12,000		
資金過不足	12,400	10,500	11,000		
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	14,100				
CP等買入			▲ 400		
貸出支援基金(成)					
貸出支援基金(貸)					
被災地支援					
社債等買入			▲ 500	1,000	
気候変動対応オペ					
E T F 買入					
国債補完供給	▲ 30,000	31,800	30,000		
当預増減	28,300	39,600	12,000		
当座預金残高	5,703,200	5,742,800	5,754,800		
準備預金残高	5,004,800				
積み終了先	4,983,900			4月19日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,957,000			積数	22,600
非準備預金先	698,400			1日平均	800
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	99.43%	日数	10.00%	

●2024年4月18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、0.01~0.02%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>

18日はTB1Y物(第1226回)の入札が実施され、強い結果となった。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、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

2024/4/18	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	0.055	0.078	0.077				-	0.026
T/N							-	0.015
S/N							-	-
1W	0.119	0.150	0.134				-	0.028
2W							-	0.031
3W							-	0.029
1M	0.160	0.240	0.183				-	0.026
3M			0.190				0.015	0.051
6M							0.025	0.075
1Y							0.140	0.113

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	▲ 0.020	38,079.70	+117.90	154.33-35	154.27-28		
日付	4/11	4/12	4/15	4/16	4/17		
日銀当預残	5,586,300	5,587,700	5,685,600	5,689,800	5,674,900		
準備預金残	4,908,800	4,910,800	5,003,500	4,998,900	4,980,400		
マネタリーベース	6,838,400	6,839,500	6,937,400	6,941,500	6,927,300		
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	112,945	119,374	120,092	117,730	113,648		
うち無担	78,904	82,883	82,969	79,520	75,478		
うちO/N	39,901	44,030	44,116	41,067	36,365		
うち有担	34,041	36,491	37,123	38,210	38,170		

●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I非価格競争入札(億円)
国庫短期証券	1226	-	32,000	2024/4/22	2025/4/21	115,719	25,759.5	99.826	0.1747%	55.4871%	99.835	0.1657%	6,240
流動性供給	404	-	5,000	2024/4/19	-	11,317	4,992		▲0.017%	88.2566%		▲0.022%	

●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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/18	2024/4/19	▲0.250	30,620	30,620		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/18	2024/4/19	▲0.250	73	73		▲0.250	▲0.250	

●2024年4月19日の予定

*3月の全国消費者物価指数(CPI)
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.6%)

*国庫短期証券(1227回)入札
(3ヶ月、58,000億円、4/22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