

Central Daily Market Report

2024年4月24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24日 需給速報	2024年4月25日 需給予想	2024年4月26日 当社予想
銀行券	▲ 1,500	▲ 1,200	▲ 1,000
財政	▲ 900	▲ 10,200	8,000
資金過不足	▲ 2,400	▲ 11,400	7,000

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			11,500			
CP等買入		▲ 500		▲ 300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 200		▲ 200		
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 30,900	29,800		30,900		
当預増減	▲ 4,200		30,500		7,000	

当座預金残高	5,701,300	5,731,800	5,738,800	
準備預金残高	5,007,400			
積み終了先	5,006,400			
超過準備	5,006,300			
非準備預金先	693,900			
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	99.86%	日数	30.00%

●短期金融市場関連指標

2024/4/24	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	0.045	0.078	0.077				-	0.057
T/N							-	0.031
S/N							-	-
1W			0.119				-	0.035
2W			0.180				-	0.036
3W							-	0.035
1M							-	0.033
3M							0.020	0.051
6M							0.025	0.075
1Y							0.130	0.109

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	+0.005	38,460.08	+907.92	154.74-76	154.89-91
日付	4/17	4/18	4/19	4/22	4/23
日銀当預残	5,674,900	5,703,200	5,710,500	5,711,700	5,705,500
準備預金残	4,980,400	5,003,500	5,004,500	5,028,300	5,016,400
マネタリーベース	6,927,300	6,956,100	6,963,700	6,965,200	6,960,000
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.077%	0.076%
コール市場残高	113,648	111,723	110,852	116,770	109,847
うち無担	75,478	74,212	73,626	78,898	73,130
うちO/N	36,365	34,089	32,773	35,955	30,307
うち有担	38,170	37,511	37,226	37,872	36,717

●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
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/4/25			13,807	4,256	▲0.005		▲0.004	94.5
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/4/25			12,856	4,755	▲0.001		0.000	84.6
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/4/25			3,174	1,503	0.001		0.004	17.8
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/4/25			1,911	754	0.018		0.019	50.6
国債買入(物価連動債)	600	2024/4/25			2,471	600		▲0.890	▲0.961	
CP等買入	4,000	2024/4/30			9,122	3,990	0.120		0.154	46.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/24	2024/4/25	▲0.150	31,445	31,445		▲0.150	▲0.150	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/24	2024/4/25	▲0.150	79	79		▲0.150	▲0.150	

●2024年4月25日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、26日まで)	*1-3月期の米GDP速報値
------------------------	----------------

◆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