

Central Daily Market Report

2024年4月25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25日 需給速報	2024年4月26日 需給予想	2024年4月30日 当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 1,000	▲ 500
財政	▲ 9,400	9,000	3,100
資金過不足	▲ 10,600	8,000	2,600

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	国債買入	CP等買入	貸出支援基金(成)	貸出支援基金(貸)
国債買入	11,500					4,000		
CP等買入		▲ 300	▲ 500					
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	▲ 300					
気候変動対応オペ								
E T F 買入								
国債補充供給	▲ 32,600	30,900	32,600					
当預増減	▲ 1,300		39,800			6,600		

当座預金残高	5,700,000	5,739,800	5,746,400	
準備預金残高	5,004,100			
積み終了先	5,003,200			
超過準備	5,003,200			
非準備預金先	695,900			
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	99.88%	日数	33.33%

●2024年4月25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0.070~0.078%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>

25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市場は、月末発行にあたり複数の業態で大型発行が散見された。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

2024/4/25	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	0.060	0.078	0.077				-	0.004
T/N							-	0.013
S/N							-	-
1W							-	0.029
2W							-	0.031
3W							-	0.033
1M			0.180				-	0.034
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)		
0.890	+0.005	37,628.48	▲ 831.60	155.26-28	155.62-64		
日付	4/18	4/19	4/22	4/23	4/24		
日銀当預残	5,703,200	5,710,500	5,711,700	5,705,500	5,701,300		
準備預金残	5,003,500	5,004,500	5,028,300	5,016,400	5,007,500		
マネタリーベース	6,956,100	6,963,700	6,965,200	6,960,000	6,957,300		
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%		
コール市場残高	111,723	110,852	116,770	109,847	114,895		
うち無担	74,212	73,626	78,898	73,130	78,557		
うちO/N	34,089	32,773	35,955	30,307	34,364		
うち有担	37,511	37,226	37,872	36,717	36,338		

●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/25	2024/4/26	▲0.250	33,294	33,294		▲0.250	▲0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/25	2024/4/26	▲0.250	0	0				

●2024年4月26日の予定

*日銀金融政策決定会合(2日目、終了後直ちに結果公表)	*3月の米個人所得・消費支出(PCE)
*日銀総裁定例会見 *経済・物価情勢の展望	
*4月の都区部消費者物価指数(CPI)	
(市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.2%)	

◆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場合があります。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