

Central Daily Market Report

2024年4月3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3日 需給速報	2024年4月4日 需給予想	2024年4月5日 当社予想			
銀行券	200	300	400			
財政	▲ 15,900	▲ 2,000	▲ 8,000			
資金過不足	▲ 15,700	▲ 1,700	▲ 7,600			
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	8,000	▲ 23,500				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			10,900			
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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 38,100	42,900	38,100			
当増増減	▲ 26,500	47,300	▲ 7,600			
当座預金残高	5,555,900	5,603,200	5,595,600			
準備預金残高	4,880,300					
積み終了先	4,880,300			4月4日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,880,300			積数	200	
非準備預金先	675,600			1日平均	0	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					4,047,500	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	61.29%		

●2024年4月3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、引き続き邦銀態を中心に資金調達ニーズが強く、出会い水準は0.075~0.078%程度で推移した。ターム物は、目立った出会いがなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.015~0.065%程度での出会いとなった。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>

3日はTB3M物(第1222回)の入札が実施され、しっかりとした結果になった。結果発表後のセカンダリーでも、堅調に推移した。

<CP市場>

CP発行市場は、大型発行を含め数件の入札が実施された。発行レートは銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られるものの、総じて0.1%以上の推移となった。

●短期金融市場関連指標

2024/4/3	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	売買参考統計値	平均値
単位：%								
O/N	0.060	0.130	0.077				-	0.019
T/N							-	0.014
S/N							-	-
1W							-	0.020
2W			0.150				-	0.025
3W							-	0.027
1M	0.137	0.150	0.141				-	0.031
3M			0.200				0.004	0.051
6M							0.040	0.074
1Y							0.090	0.104

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)
0.765	0.000	39,451.85	▲ 387.06	151.54-55	151.67-69
日付	3/27	3/28	3/29	4/1	4/2
日銀当預残	5,580,600	5,582,400	5,611,900	5,596,100	5,582,400
準備預金残	4,922,800	4,917,000	4,942,800	4,910,300	4,900,600
マネタリーベース	6,837,400	6,839,300	6,867,900	6,851,500	6,837,600
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.074%	0.077%	0.077%
コール市場残高	120,541	119,910	121,665	114,927	111,170
うち無担	86,911	85,509	94,421	84,914	79,915
うちO/N	46,548	46,706	64,568	51,621	44,647
うち有担	33,630	34,401	27,244	30,013	31,255

●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	棄分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非償格競争入札(億円)	非競争入札(億円)
国庫短期証券	1222	-	58,000	2024/4/4	2024/7/8	159,855.3	46,931.5	99,996.5	0.0134%	75.4148%	99.9988	0.0046%	11,068	
交付税特会	-	-	13,000	2024/4/11	2024/10/11	83,624	12,990		0.110%	77.7834%		0.097%		10

●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1年以下)	1,500	2024/4/4			2,296	1,501	▲0.005		0.012	89.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,750	2024/4/4			7,887	3,754	▲0.006		▲0.004	92.8
国債買入(残存期間3年超5年以下)	4,250	2024/4/4			8,789	4,257	▲0.007		▲0.005	94.9
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/4/4			3,405	1,504	0.006		0.008	45.0
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/3	2024/4/4	▲0.250	38,576	38,576		▲0.250	▲0.250	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/3	2024/4/4	▲0.250	0	0				

●2024年4月4日の予定

*2月の米貿易収支	*30年利付国債入札 (9,000億円、4/5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ものがあります。金融商品取引法に基づきお預り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