

# Central Daily Market Report

2024年4月8日(月)  
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8日 需給速報	2024年4月9日 需給予想	2024年4月10日 当社予想			
銀行券	1,000	700	▲ 500			
財政	▲ 2,300	10,300	▲ 23,000			
資金過不足	▲ 1,300	11,000	▲ 23,500			
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			9,200			
CP等買入		▲ 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						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 42,100	36,400	42,100			
当預増減	▲ 7,500	62,300	▲ 23,500			
当座預金残高	5,570,500	5,632,800	5,609,300			
準備預金残高	4,900,800					
積み終了先	4,900,800			4月9日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,900,800			積数	100	
非準備預金先	669,700			1日平均	0	
積み期間(3/16~4/15)の所要準備額					4,056,600	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	77.42%		

## ●2024年4月8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、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、出合い水準は0.075~0.078%程度で推移した。ターム物は目立った出合いがなく閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.03~0.055%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>

8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発行市場は複数の発行が観測された。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

2024/4/8	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				-	0.048
T/N							-	0.042
S/N							-	-
1W							-	0.036
2W			0.140				-	0.036
3W							-	0.037
1M			0.220				-	0.035
3M							▲ 0.001	0.053
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)
0.785	+0.020	39,347.04	+354.96	151.67-69	151.87-88
日付	4/1	4/2	4/3	4/4	4/5
日銀当預残	5,596,100	5,582,400	5,555,900	5,570,000	5,578,000
準備預金残	4,910,300	4,900,600	4,880,500	4,905,900	4,910,600
マネタリーベース	6,851,500	6,837,600	6,810,900	6,824,600	6,831,800
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	114,927	111,170	120,970	124,625	120,075
うち無担	84,914	79,915	87,911	88,933	86,466
うちO/N	51,621	44,647	51,618	51,510	48,723
うち有担	30,013	31,255	33,059	35,692	33,609

## ●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	2024/4/9			11,680	3,755	0.008		0.009	4.3
国債買入(残存期間5年超10年以下)	4,750	2024/4/9			6,532	4,753	0.008		0.013	29.7
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/4/9			1,902	755	0.025		0.026	54.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/8	2024/4/9	▲0.150	42,541	42,541		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/8	2024/4/9	▲0.150	18	18		▲0.150	▲0.150	

## ●2024年4月9日の予定

*3月の消費動向調査	*国庫短期証券(1224回)入札(6ヶ月、40,000億円、4/10発行)	*5年利付国債入札(23,000億円、4/10発行)	*エネルギー対策借入(8,144億円、4/22借入)
------------	---------------------------------------	----------------------------	----------------------------

◆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