

# Central Daily Market Report

2024年4月15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15日 需給速報	2024年4月16日 需給予想	2024年4月17日 当社予想			
銀行券	▲ 100	200	▲ 500			
財政	84,000	3,600	2,000			
資金過不足	83,900	3,800	1,500			
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						▲ 8,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入	12,900					
CP等買入	4,000	▲ 200	▲ 800			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 700	▲ 100			
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補充供給	▲ 35,200	33,200	35,200			
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	97,900	38,100	▲ 6,500			
当座預金残高	5,685,600	5,723,700	5,717,200			
準備預金残高	5,003,500					
積み終了先	5,003,500			4月16日以降の残り所要積立額		
超過準備	5,003,500			積数	3,955,000	
非準備預金先	682,100			1日平均	131,800	
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	0.00%	日数	0.00%		

## ●2024年4月15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、積み最終日となったが大きな変化は無く、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強く、出会い水準は0.070~0.078%程度で推移した。ターム物は目立った出会いがなく閑散であった。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.05~0.075%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>

15日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

### <CP市場>

CP発行市場は、数件の入札が実施された。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

2024/4/15	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	
	単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	0.065	0.078	0.077					-	0.065
T/N								-	0.062
S/N								-	-
1W								-	0.053
2W								-	0.051
3W								-	0.050
1M								-	0.045
3M								0.010	0.051
6M								0.025	0.076
1Y								0.110	0.107

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)
0.860	0.000	39,232.80	▲ 290.75	153.30-32	153.90-91
日付	4/8	4/9	4/10	4/11	4/12
日銀当預残	5,570,500	5,595,400	5,583,700	5,586,300	5,587,700
準備預金残	4,900,800	4,919,300	4,919,000	4,908,800	4,910,800
マネタリーベース	6,823,300	6,847,600	6,835,800	6,838,400	6,839,500
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	119,262	114,092	121,405	112,945	119,374
うち無担	84,252	83,141	85,473	78,904	82,883
うちO/N	46,609	44,948	46,650	39,901	44,030
うち有担	35,010	30,951	35,932	34,041	36,491

## ●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
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/15	2024/4/16	▲0.150	35,800	35,800		▲0.150	▲0.150	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/15	2024/4/16	▲0.150	30	30		▲0.150	▲0.150	

## ●2024年4月16日の予定

*3月の米住宅着工件数	*流動性供給入札
*3月の米鉱工業生産・設備稼働率	(6,000億円、4/17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