

Central Daily Market Report

2024年4月26日(金)

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26日 需給速報	2024年4月30日 需給予想	2024年5月1日 当社予想
銀行券	▲ 1,200	▲ 900	▲ 1,000
財政	1,400	3,000	▲ 20,500
資金過不足	200	2,100	▲ 21,500

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						▲ 7,000
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 500	4,000	▲ 1,300		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入		▲ 300				
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 32,400	32,600		32,400		
当預増減	▲ 400		37,200		▲ 28,500	

当座預金残高	5,699,600	5,736,800	5,708,300
準備預金残高	5,010,700		
積み終了先	5,010,700		
超過準備	5,009,800		
非準備預金先	688,900		
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 99.98%	日数 46.67%	

●短期金融市場関連指標

2024/4/26	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
O/N	0.050	0.078	0.077				-	0.021
T/N							-	0.012
S/N							-	-
1W							-	0.027
2W	0.150	0.200	0.172				-	0.031
3W							-	0.033
1M			0.170				-	0.033
3M							0.020	0.052
6M							0.045	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)
0.920	+0.030	37,934.76	+306.28	155.61-63	156.70-71
日付	4/19	4/22	4/23	4/24	4/25
日銀当預残	5,710,500	5,711,700	5,705,500	5,701,300	5,700,000
準備預金残	5,004,500	5,028,300	5,016,400	5,007,500	5,004,100
マネタリーベース	6,963,700	6,965,200	6,960,000	6,957,300	6,957,100
無担O/N加重平均	0.077%	0.077%	0.076%	0.077%	0.077%
コール市場残高	110,852	116,770	109,847	114,895	115,617
うち無担	73,626	78,898	73,130	78,557	78,302
うちO/N	32,773	35,955	30,307	34,364	33,759
うち有担	37,226	37,872	36,717	36,338	37,315

●入札結果

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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/26	2024/4/30	▲0.250	33,104	33,104		▲0.250	▲0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/26	2024/4/30	▲0.250	0	0				

●4月29日の予定

*昭和の日

●4月30日の予定

*3月の完全失業率(市場予想:2.5%)
*3月の有効求人倍率(市場予想:1.26倍)
*3月の商業動態統計速報
*3月の鉱工業生産・出荷・在庫速報(市場予想:前月比+3.5%)
*3月の住宅着工統計

*米FOMC(1日目)
*2月のS&P/ケース・シラー住宅価格指数
*4月のシカゴPM景況感指数
*4月の米CB消費者信頼感指数
*4月のユーロ圏消費者物価指数速報値
*1-3月期のユーロ圏GDP1次速報

●日銀政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、以下のとおり決定した。(全員一致)
無担保コールレート(オーバーナイト物)を、0~0.1%程度で推移するように促す。

なお、長期国債およびCP等・社債等の買入れについては、2024年3月の金融政策決定会合において決定された方針に沿って実施する。

◆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よう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