

# Central Daily Market Report

2024年4月30日(火)

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30日 需給速報	2024年5月1日 需給予想	2024年5月2日 当社予想	
銀行券	▲ 900	▲ 800	▲ 1,000	
財政	8,500	▲ 75,600	▲ 30,000	
資金過不足	7,600	▲ 76,400	▲ 31,000	
金融調節	スタート	スタート	スタート	
貸出	エンド	エンド	エンド	
全店共通		6,500	▲ 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	4,000	▲ 1,300	▲ 700	
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	▲ 38,900	32,400	38,900	
当預増減	3,800	▲ 38,700	▲ 31,000	
当座預金残高	5,703,400	5,664,700	5,633,700	
準備預金残高	5,021,700			
積み終了先	5,021,600			
超過準備	5,021,600			
非準備預金先	681,700			
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	50.00%

## ●2024年4月30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、月末要因により一部でビッドを控える動きが見られたものの影響は小さく、引き続き邦銀業態を中心に資金調達ニーズの強い展開となった。出合い水準は、0.070~0.078%程度で推移した。ターム物は、一部業態による調達が散見された。

### <レポ市場>

GC T/Nは、0.005~0.075%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>

30日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、6M物に出合いが見られた。

### <CP市場>

CP発行市場は案件が少なく、閑散としたマーケットとなった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

2024/4/30	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	売買参考値 平均値
O/N	0.050	0.078	0.076				-	0.001
T/N							-	0.008
S/N							-	-
1W							-	0.025
2W			0.170				-	0.031
3W							-	0.031
1M			0.180				-	0.033
3M	0.180	0.580	0.194				0.020	0.051
6M							0.040	0.075
1Y							0.130	0.113

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)
0.870	▲ 0.050	38,405.66	+470.90	156.32-33	156.85-87
日付	4/22	4/23	4/24	4/25	4/26
日銀当預残	5,711,700	5,705,500	5,701,300	5,700,000	5,699,600
準備預金残	5,028,300	5,016,400	5,007,500	5,004,100	5,010,700
マネタリーベース	6,965,200	6,960,000	6,957,300	6,957,100	6,957,900
無担O/N加重平均	0.077%	0.076%	0.077%	0.077%	0.077%
コール市場残高	116,770	109,847	114,895	115,617	115,077
うち無担	78,898	73,130	78,557	78,302	79,366
うちO/N	35,955	30,307	34,364	33,759	35,843
うち有担	37,872	36,717	36,338	37,315	35,711

## ●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
米ドル資金供給		2024/5/2	2024/5/9	5.580	0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/4/30	2024/5/1	▲0.250	39,552	39,552		▲0.250	▲0.250	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/5/1	2024/5/15	0.100	6,510	6,510				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/4/30	2024/5/1	▲0.250	220	220		▲0.250	▲0.250	

## ●5月1日の予定

*米FOMC(2日目)	*4月のISM製造業景況指数	*3月の米建設支出	*EURO祝日(Labour Day)
-------------	----------------	-----------	---------------------

◆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