

●資金需給

単位：億円	2024年9月30日 需給速報		2024年10月1日 需給予想		2024年10月2日 当社予想	
銀行券	500		▲ 500		600	
財政	9,300		▲ 25,200		▲ 39,000	
資金過不足	9,800		▲ 25,700		▲ 38,400	
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						
CP等買入	4,000	▲ 3,100				
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						
国債補完供給	▲ 14,700	15,300		14,700		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	11,300		▲ 11,000		▲ 46,400	
当座預金残高	5,494,300		5,483,300		5,436,900	
準備預金残高	4,950,800					
積み終了先	4,950,000		10月1日以降の残り所要積立額			
超過準備	4,950,000		積数		4,200	
非準備預金先	543,500		1日平均		300	
積み期間（9/16～10/15）の所要準備額					3,940,700	
準備預金進捗率	実績 99.89%		日数		50.00%	

●短期金融市場関連指標

2024/9/30	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	0.217	0.228	0.225				－	0.232
T/N							－	0.238
S/N							－	－
1W	0.227	0.269	0.232				－	0.199
2W							－	0.199
3W							－	0.198
1M			0.300				－	0.199
3M							0.030	0.207
6M							0.090	0.250
1Y							0.200	0.318

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）
0.850	+0.045	37,919.55	▲ 1,910.01	142.78-80	142.37-39
日付					
9/20	9/24	9/25	9/26	9/27	
日銀当預残	5,479,900	5,486,000	5,488,700	5,500,400	5,483,000
準備預金残	4,942,500	4,930,700	4,943,300	4,961,900	4,946,400
マネタリーベース	6,721,000	6,727,200	6,729,600	6,741,500	6,723,800
無担O/N加重平均	0.226%	0.226%	0.226%	0.226%	0.226%
コール市場残高	118,236	121,885	116,998	113,661	108,573
うち無担	77,587	76,618	71,912	72,159	68,695
うちO/N	34,997	34,398	30,232	30,364	27,440
うち有担	40,649	45,267	45,086	41,502	39,878

●入札結果

名称	回数	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	案分率	募入 平均価格	募入平均利回・利 回較差	第1非面 格競争入 札（億円）	非競争 入札（億 円）
2年利付国債	465	0.4%	26,000	2024/10/1	2026/10/1	74,764	19,598	100.005	0.397%	19.5417%	100.014	0.392%	6.392	1.74

●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）		2024/9/30	2024/10/1	▲0.050	14,916	14,916		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/9/30	2024/10/1	▲0.050	0	0				

●2024年10月1日の予定

*9月調査の日銀短観（概要及び要旨） *決定会合における主な意見（9月19・20日分） *8月の完全失業率（市場予想：2.6%） *8月の有効求人倍率（市場予想：1.24倍）	*9月のISM製造業景況指数 *8月の米建設支出 *9月のユーロ圏消費者物価指数速報値	*交付税特別会計借入 （13,000億円、10/11借入）
--	---	----------------------------------

◆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