

Central Daily Market Report

2024年10月1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10月1日 需給速報 | 2024年10月2日 需給予想 | 2024年10月3日 当社予想 |
|-------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 銀行券 | ▲ 600 | 400 | ▲ 100 |
| 財政 | ▲ 28,300 | ▲ 51,200 | ▲ 500 |
| 資金過不足 | ▲ 28,900 | ▲ 50,800 | ▲ 600 |

| 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 | 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 | ▲ 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 | | | | | | | | |
| 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 | ▲ 14,500 | 14,700 | | 14,500 | | | | |
| ※ F T F 資金供給用国債補完供給 | | | | | | | | |
| 当預増減 | ▲ 28,700 | | ▲ 36,300 | | | | ▲ 600 | |

| | | | | |
|------------------------|-----------|-----------|-----------|--------|
| 当座預金残高 | 5,465,600 | 5,429,300 | 5,428,700 | |
| 準備預金残高 | 4,941,600 | | | |
| 積み終了先 | 4,940,700 | | | |
| 超過準備 | 4,940,700 | | | |
| 非準備預金先 | 524,000 | | | |
| 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 | 99.92% | 日数 | 53.33% |

●短期金融市場関連指標

| 2024/10/1 | 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 | 0.220 | 0.290 | 0.227 | | | | - | 0.242 |
| T/N | | | | | | | - | 0.239 |
| S/N | | | | | | | - | - |
| 1W | 0.234 | 0.390 | 0.250 | | | | - | 0.202 |
| 2W | 0.227 | 0.400 | 0.270 | | | | - | 0.200 |
| 3W | | | | | | | - | 0.200 |
| 1M | 0.280 | 0.285 | 0.283 | | | | - | 0.200 |
| 3M | | | | | | | 0.035 | 0.207 |
| 6M | | | | | | | 0.090 | 0.252 |
| 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 | 0.000 | 38,651.97 | +732.42 | 143.70-72 | 144.16-19 |

| 日付 | 9/24 | 9/25 | 9/26 | 9/27 | 9/30 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 日銀当預残 | 5,486,000 | 5,488,700 | 5,500,400 | 5,483,000 | 5,494,300 |
| 準備預金残 | 4,930,700 | 4,943,300 | 4,961,900 | 4,946,400 | 4,951,000 |
| マネタリーベース | 6,727,200 | 6,729,600 | 6,741,500 | 6,723,800 | 6,734,600 |
| 無担O/N加重平均 | 0.226% | 0.226% | 0.226% | 0.226% | 0.225% |
| コール市場残高 | 121,885 | 116,998 | 113,661 | 108,573 | 106,923 |
| うち無担 | 76,618 | 71,912 | 72,159 | 68,695 | 68,331 |
| うちO/N | 34,398 | 30,232 | 30,364 | 27,440 | 30,501 |
| うち有担 | 45,267 | 45,086 | 41,502 | 39,878 | 38,592 |

●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非償格募入札(億円) | 非償募入札(億円) |
|-------|----|------|--------|------------|-----------|---------|-----------|-------|-------------|----------|--------|-------------|--------------|-----------|
| 交付税特会 | - | - | 13,000 | 2024/10/11 | 2025/4/11 | 65,953 | 12,990.02 | | 0.294% | 35.3350% | | 0.274% | | 10 |

●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 | | 2024/10/3 | 2024/10/10 | 5.070 | 1 | 1 | | | | |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | | 2024/10/1 | 2024/10/2 | ▲0.050 | 14,720 | 14,720 | | ▲0.050 | ▲0.050 | |
| 共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉 | 8,000 | 2024/10/2 | 2024/10/16 | 0.250 | 12,183 | 8,006 | | | | 65.7 |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分) | | 2024/10/1 | 2024/10/2 | ▲0.050 | 79 | 79 | | ▲0.050 | ▲0.050 | |

●2024年10月2日の予定

| |
|----------------------|
| *9月のマネタリーベース |
| *9月の消費動向調査 |
| *財政資金対民間収支前月実績/当月見込み |

◆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

●2024年10月1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、9月末を通過し、調達の再開からビッド件数が増加したものの、相場に大きな変化はなく、レートは0.225~0.227%程度で推移した。
ターム物は、証券業態の調達を中心に引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.235~0.24%程度での出会いとなった。
SCI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>

1日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額の出会いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は、一部の業態で大型発行が実施された。発行レートは0.25%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。