

Central Daily Market Report

2024年10月2日(水)

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2日 需給速報	2024年10月3日 需給予想	2024年10月4日 当社予想
銀行券	400	▲ 400	600
財政	▲ 52,700	700	▲ 25,000
資金過不足	▲ 52,300	300	▲ 24,400

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	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入			8,600			
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						
国債補充供給	▲ 12,200	14,500		12,200		
当預増減	▲ 50,000		21,100		▲ 24,400	

当座預金残高	5,415,600	5,436,700	5,412,300
準備預金残高	4,859,900		
積み終了先	4,859,300		
超過準備	4,859,300		
非準備預金先	555,700		
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 99.93%	日数 56.67%	

●短期金融市場関連指標

2024/10/2	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	0.227	0.227				-	0.242
T/N							-	0.230
S/N							-	-
1W	0.226	0.390	0.253				-	0.201
2W	0.227	0.310	0.235				-	0.200
3W							-	0.200
1M	0.290	0.300	0.295				-	0.200
3M							0.035	0.208
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)
0.815	▲ 0.035	37,808.76	▲ 843.21	143.72-74	144.05-08
日付	9/25	9/26	9/27	9/30	10/1
日銀当預残	5,488,700	5,500,400	5,483,000	5,494,300	5,465,600
準備預金残	4,943,300	4,961,900	4,946,400	4,951,000	4,936,800
マネタリーベース	6,729,600	6,741,500	6,723,800	6,734,600	6,706,500
無担O/N加重平均	0.226%	0.226%	0.226%	0.225%	0.227%
コール市場残高	116,998	113,661	108,573	106,923	110,691
うち無担	71,912	72,159	68,695	68,331	69,311
うちO/N	30,232	30,364	27,440	30,501	28,631
うち有担	45,086	41,502	39,878	38,592	41,380

●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
国債買入(残存期間1年以下)	1,500	2024/10/3			3,031	1,503	▲0.005		0.006	28.0
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2024/10/3			11,297	3,256	▲0.017		▲0.016	96.4
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2024/10/3			11,358	3,259	▲0.014		▲0.014	65.8
国債買入(残存期間25年超)	750	2024/10/3			1,506	752	▲0.008		▲0.004	17.8
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/10/2	2024/10/3	▲0.050	12,445	12,445		▲0.050	▲0.050	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/2	2024/10/3	▲0.050	0	0				

●2024年10月3日の予定

*長崎県金融経済懇談会において 野口日銀審議委員講演 *10月の日銀当座預金増減要因見込み	*9月のISM非製造業景況指数 *8月の米製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札 (26,000億円、10/4発行) *交付税特別会計借入 (13,000億円、10/17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2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、引き続き邦銀勢からの旺盛な資金調達ニーズを背景に、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、0.245~0.25%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>

2日のアウトラ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、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。