

Central Daily Market Report

2024年10月3日(木)

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3日 需給速報	2024年10月4日 需給予想	2024年10月7日 当社予想
銀行券	▲ 500	600	1,000
財政	2,100	▲ 26,500	6,000
資金過不足	1,600	▲ 25,900	7,000

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						
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						
ETF買入						
国債補完供給	▲ 11,300	12,200		11,300		
当預増減	11,100	▲ 14,600				7,000

当座預金残高	5,426,700	5,412,100	5,419,100	
準備預金残高	4,870,400			
積み終了先	4,870,000			
超過準備	4,870,000			
非準備預金先	556,300			
10月4日以降の残り所要積立額				
積数		2,200		
1日平均		200		
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	99.94%	日数	60.00%

●2024年10月3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、0.23~0.25%程度での出合いとなった。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>

3日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出合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。

●短期金融市場関連指標

2024/10/3	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	0.220	0.227	0.227					0.242
T/N								0.234
S/N								-
1W								0.200
2W			0.295					0.200
3W								0.200
1M	0.280	0.460	0.328					0.200
3M			0.350					0.035
6M								0.090
1Y								0.200

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)
0.860	+0.045	38,552.06	+743.30	146.54-56	146.45-46
日付	9/26	9/27	9/30	10/1	10/2
日銀当預残	5,500,400	5,483,000	5,494,300	5,465,600	5,415,600
準備預金残	4,961,900	4,946,400	4,951,000	4,936,800	4,859,900
マネタリーベース	6,741,500	6,723,800	6,734,600	6,706,500	6,656,100
無担O/N加重平均	0.226%	0.226%	0.225%	0.227%	0.227%
コール市場残高	113,661	108,573	106,923	110,691	113,250
うち無担	72,159	68,695	68,331	69,311	71,329
うちO/N	30,364	27,440	30,501	28,631	29,174
うち有担	41,502	39,878	38,592	41,380	41,921

●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非備 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
10年利付国債	376	0.9%	26,000	2024/10/4	2034/9/20	69,207	19,612	100.24	0.873%	38.5929%	100.26	0.871%	6,355	23.38
交付税特会	-	-	13,000	2024/10/17	2025/4/15	68,164	12,990		0.285%	54.7668%		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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/10/3	2024/10/4	▲0.050	11,543	11,543		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/3	2024/10/4	▲0.050	0	0				

●2024年10月4日の予定

*9月の米雇用統計	*国庫短期証券(1260回)入札 (46,000億円、10/7発行)
-----------	---------------------------------------

◆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