

Central Daily Market Report

2024年10月4日（金）
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4日 需給速報	2024年10月7日 需給予想	2024年10月8日 当社予想			
銀行券	600	400	1,000			
財政	▲ 26,900	4,900	1,000			
資金過不足	▲ 26,300	5,300	2,000			
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						
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	▲ 11,200	11,300		11,200		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 26,200		16,500		2,000	
当座預金残高	5,400,500		5,417,000		5,419,000	
準備預金残高	4,843,900					
積み終了先	4,843,900				10月7日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,843,300				積数	400
非準備預金先	556,600				1日平均	0
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	99.99%	日数	70.00%		

●2024年10月4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、3日積みとなった事で邦銀勢からの資金調達ニーズが一段と強まったものの、レート水準に大きな変化は無く、引き続き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、0.235～0.25%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＞

4日はTB3M物（第1260回）の入札が実施され、事前予想に比べ強い結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、堅調に推移した。

＜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

2024/10/4	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	売買参考統計値	平均値
O/N	0.221	0.228	0.227				－	0.241
T/N							－	0.240
S/N							－	－
1W							－	0.201
2W							－	0.200
3W							－	0.200
1M							－	0.200
3M							▲ 0.005	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)
0.880	+0.020	38,635.62	+83.56	146.85-87	146.30-32

日付		9/27	9/30	10/1	10/2	10/3
日銀当預残		5,483,000	5,494,300	5,465,600	5,415,600	5,426,700
準備預金残		4,946,400	4,951,000	4,936,800	4,859,900	4,870,200
マネタリーベース		6,723,800	6,734,600	6,706,500	6,656,100	6,667,600
無担O/N加重平均		0.226%	0.225%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高		108,573	106,923	110,691	113,250	109,236
うち無担		68,695	68,331	69,311	71,329	70,061
うちO/N		27,440	30,501	28,631	29,174	26,686
うち有担		39,878	38,592	41,380	41,921	39,175

●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・利 回較差	案分率	募入 平均価格	募入平均利回・利 回較差	第Ⅰ非価格 競争入札(億円)
国庫短期証券	1260	－	46,000	2024/10/7	2025/1/14	120,210	35,141.6	99.9945	0.0202%	59.2906%	99.9980	0.0073%	10,858

●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）		2024/10/4	2024/10/7	▲0.050	11,398	11,398		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/10/4	2024/10/7	▲0.050	0	0				

●2024年10月7日の予定

*9月のマネタリーベースと日本銀行の取引 *8月の景気動向指数速報	*8月の米消費者信用残高
--------------------------------------	--------------

◆本資料は信頼できると思わ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