

Central Daily Market Report

2024年10月8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8日 需給速報		2024年10月9日 需給予想		2024年10月10日 当社予想					
銀行券	100		100		▲ 1,000					
財政	▲ 3,500		▲ 9,400		5,000					
資金過不足	▲ 3,400		▲ 9,300		4,000					
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	11,700									
CP等買入		▲ 200								
貸出支援基金(成)										
貸出支援基金(貸)										
被災地支援										
社債等買入				▲ 200						
気候変動対応オペ										
E T F 買入										
国債補完供給	▲ 11,100	11,100		11,100						
※ドル資金供給用国債国債供給										
当預増減	8,100		1,600		4,000					
当座預金残高	5,411,300		5,412,900		5,416,900					
準備預金残高	4,836,400		10月9日以降の残り所要積立額 <table><tr><td>積数</td><td>300</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				積数	300	1日平均	0
積数	300									
1日平均	0									
積み終了先	4,836,300									
超過準備	4,836,300									
非準備預金先	574,900									
積み期間（9/16～10/15）の所要準備額					3,924,400					
準備預金進捗率	実績 99.99%		日数		76.67%					

●2024年10月8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、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られており、出会い水準は0.225～0.227%程度と横ばい圏で推移した。ターム物は目立った出会いがなく閑散であった。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.19～0.205%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＞

8日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物と3M物で出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。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

2024/10/8	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	0.220	0.227	0.227				－	0.191
T/N							－	0.188
S/N							－	－
1W	0.230	0.390	0.271				－	0.200
2W							－	0.200
3W							－	0.200
1M			0.290				－	0.201
3M							0.004	0.209
6M							0.090	0.252
1Y							0.205	0.317

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)
0.920	0.000	38,937.54	▲ 395.20	148.13-16	147.59-60
日付					
10/1	10/2	10/3	10/4	10/7	
日銀当預残	5,465,600	5,415,600	5,426,700	5,400,500	5,403,200
準備預金残	4,936,800	4,859,900	4,870,200	4,843,900	4,840,700
マネタリーベース	6,706,500	6,656,100	6,667,600	6,640,900	6,643,300
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	110,691	113,250	109,236	112,016	116,268
うち無担	69,311	71,329	70,061	74,258	75,090
うちO/N	28,631	29,174	26,686	30,993	30,785
うち有担	41,380	41,921	39,175	37,758	41,178

●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)
30年利付国債	84	2.1%	9,000	2024/10/9	2054/9/20	22,728	6,797	98.95	2.157%	88.5641%	99.05	2.152%	2,195

●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		2024/10/10	2024/10/17	5.080	0	0				
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/10/8	2024/10/9	▲ 0.050	11,408	11,408		▲ 0.050	▲ 0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/10/8	2024/10/9	▲ 0.050	10	10		▲ 0.050	▲ 0.050	

●2024年10月9日の予定

*8月の米卸売売上高	*国庫短期証券(1261回)入札 (6ヶ月、35,000億円、10/10発行)
------------	--

◆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ものがあります。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