

Central Daily Market Report

2024年10月9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9日 需給速報	2024年10月10日 需給予想	2024年10月11日 当社予想
銀行券	100	▲ 200	▲ 1,000
財政	▲ 6,300	5,400	▲ 21,000
資金過不足	▲ 6,200	5,200	▲ 22,000
金融調節	スタート	エンド	スタート
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		▲ 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	▲ 100	
気候変動対応オペ			
E T F 買入			
国債補完供給	▲ 9,300	11,100	9,300
※ F T F 資金供給用国債国債供給			
当預増減	▲ 4,600	14,200	▲ 22,000
当座預金残高	5,406,700	5,420,900	5,398,900
準備預金残高	4,836,500		
積み終了先	4,836,400		
超過準備	4,836,400		
非準備預金先	570,200		
10月10日以降の残り所要積立額			
積数		200	
1日平均		0	
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	80.00%

●2024年10月9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、出合い水準は0.225～0.227%程度と横ばい圏で推移した。ターム物はショートターム物を中心に引き合いが見られた。

＜レポ市場＞

GC T/Nは、0.20～0.24%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＞

9日はTB6M物（第1261回）の入札が実施され、事前予想に比べ甘く、テールが流れる結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、テール近辺での出合いが見られた。

＜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

2024/10/9	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				－	0.197
T/N							－	0.230
S/N							－	－
1W			0.390				－	0.200
2W							－	0.200
3W							－	0.200
1M			0.310				－	0.201
3M			0.300				0.005	0.209
6M							0.080	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)
0.930	+0.010	39,277.96	+340.42	148.14-16	148.55-57

日付	10/2	10/3	10/4	10/7	10/8
日銀当預残	5,415,600	5,426,700	5,400,500	5,403,200	5,411,300
準備預金残	4,859,900	4,870,200	4,843,900	4,840,700	4,834,600
マネタリーベース	6,656,100	6,667,600	6,640,900	6,643,300	6,651,300
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	113,250	109,236	112,016	116,268	116,011
うち無担	71,329	70,061	74,258	75,090	74,417
うちO/N	29,174	26,686	30,993	30,785	29,962
うち有担	41,921	39,175	37,758	41,178	41,594

●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	1261	－	35,000	2024/10/10	2025/4/10	89,785	27,939.8	99.957	0.0862%	52.0891%	99.965	0.0702%	7,060

●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）		2024/10/9	2024/10/10	▲0.050	9,548	9,548		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/10/9	2024/10/10	▲0.050	0	0				

●2024年10月10日の予定

*9月の企業物価指数 *8月の特定サービス産業動態統計速報	*9月の米消費者物価指数 *9月の米財政収支	*5年利付国債入札 （23,000億円、10/11発行） *エネルギー対策借入 （6,301億円、10/21借入）
----------------------------------	---------------------------	--

◆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