

●資金需給

単位：億円	2024年10月11日 需給速報		2024年10月15日 需給予想		2024年10月16日 当社予想							
銀行券	▲ 300		▲ 200		500							
財政	▲ 27,400		89,500		▲ 6,500							
資金過不足	▲ 27,700		89,300		▲ 6,000							
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						▲ 8,000						
国債買現												
国債売現												
国庫短期証買入												
国債買入			8,500									
CP等買入		▲ 300		▲ 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												
気候変動対応オペ												
E T F 買入												
国債補完供給	▲ 9,200	9,600		9,200								
※ドル資金供給用国債国債供給												
当預増減	▲ 27,600		106,800		▲ 14,000							
当座預金残高	5,381,300		5,488,100		5,474,100							
準備預金残高	4,832,500		<table><tr><td>10月15日以降の残り所要積立額</td><td></td></tr><tr><td>積数</td><td>0</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>0</td></tr></table>				10月15日以降の残り所要積立額		積数	0	1日平均	0
10月15日以降の残り所要積立額												
積数	0											
1日平均	0											
積み終了先	4,832,500											
超過準備	4,832,500											
非準備預金先	548,800											
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 100.00%		日数		96.67%							

●2024年10月11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、週末4日積みとなり、邦銀業態を中心に資金調達ニーズが強まったが、出会い水準に大きな変化は見られず、引き続き0.225～0.227%程度で推移した。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、0.24～0.25%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＞

11日はTB3M物（第1262回）の入札が実施され、引き続き強い水準での決着となった。結果発表後のセカンダリーマーケットは、閑散で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、概ね横ばい圏となる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

2024/10/11	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	0.221	0.227	0.227				－	0.248
T/N							－	0.245
S/N							－	－
1W			0.226				－	0.201
2W			0.227				－	0.202
3W							－	0.201
1M							－	0.202
3M							0.000	0.210
6M							0.082	0.252
1Y							0.220	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)
0.945	▲ 0.010	39,605.80	+224.91	148.71-73	148.77-79
日付	10/4	10/7	10/8	10/9	10/10
日銀当預残	5,400,500	5,403,200	5,411,300	5,406,700	5,408,900
準備預金残	4,843,900	4,840,700	4,834,600	4,836,500	4,836,700
マネタリーベース	6,640,900	6,643,300	6,651,300	6,646,600	6,649,000
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	112,016	116,268	116,011	114,233	114,942
うち無担	74,258	75,090	74,417	74,398	74,846
うちO/N	30,993	30,785	29,962	29,688	29,016
うち有担	37,758	41,178	41,594	39,835	40,096

●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	1262	－	43,000	2024/10/15	2025/1/20	109,767	32,424.8	99.9965	0.0131%	31.8132%	99.9982	0.0067%	10,575

●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年超3年以下）	3,250	2024/10/15			10,562	3,254	0.002		0.003	86.4
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,750	2024/10/15			9,268	3,753	▲0.011		▲0.009	79.9
国債買入（残存期間10年超25年以下）	1,500	2024/10/15			2,471	1,503	▲0.018		▲0.012	31.8
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/10/11	2024/10/15	▲0.050	9,473	9,473		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/10/11	2024/10/15	▲0.050	0	0				

●2024年10月14日の予定

*スポーツの日	*New York祝日 (Columbus Day)
---------	----------------------------

●2024年10月15日の予定

*流動性供給入札（6,500億円、10/16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