

●資金需給

単位：億円	2024年10月17日 需給速報		2024年10月18日 需給予想		2024年10月21日 当社予想	
銀行券	▲ 400		▲ 300		1,000	
財政	3,700		3,200		16,500	
資金過不足	3,300		2,900		17,500	
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				▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入				▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 8,600	9,200		8,600		
※ FDL資金供給用国債国債供給						
当預増減	3,900		11,300		17,500	
当座預金残高	5,474,500		5,485,800		5,503,300	
準備預金残高	4,912,500					
積み終了先	4,834,400				10月18日以降の残り所要積立額	
超過準備	4,490,300				積数	93,200
非準備預金先	562,000				1日平均	3,200
積み期間（10/16～11/15）の所要準備額					4,041,000	
準備預金進捗率	実績 97.69%		日数		6.45%	

●2024年10月17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、引き続き邦銀業態を中心に堅調な資金調達ニーズがみられていることから、出会い水準に大きな変化はなく、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、0.235～0.24%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＞

17日はTB1Y物(第1263回)の入札が実施され、事前予想通りの結果となった。結果発表後のセカンダリーでは、底堅く推移した。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の業態から発行が実施された。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

2024/10/17	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				－	0.237
T/N							－	0.235
S/N							－	－
1W			0.390				－	0.203
2W			0.295				－	0.201
3W							－	0.201
1M			0.285				－	0.201
3M							0.000	0.210
6M							0.090	0.256
1Y							0.285	0.321

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)
0.960	+0.010	38,911.19	▲ 269.11	149.55-57	149.76-78

日付	10/9	10/10	10/11	10/15	10/16
日銀当預残	5,406,700	5,408,900	5,381,300	5,476,100	5,470,600
準備預金残	4,836,500	4,836,700	4,832,500	4,910,200	4,896,400
マネタリーベース	6,646,600	6,649,000	6,621,700	6,716,700	6,710,400
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	114,233	114,942	112,101	113,878	109,875
うち無担	74,398	74,846	72,059	74,369	70,714
うちO/N	29,688	29,016	26,769	28,889	25,134
うち有担	39,835	40,096	40,042	39,509	39,161

●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	1263	－	32,000	2024/10/21	2025/10/20	76,200	25,104.9	99.703	0.2987%	57.2072%	99.713	0.2886%	6.895
流動性供給	416	－	4,000	2024/10/18	－	12,787	3,993		▲0.017%	72.7002%		▲0.017%	

●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)		2024/10/17	2024/10/18	▲0.050	8,856	8,856		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/17	2024/10/18	▲0.050	0	0				

●2024年10月18日の予定

*9月の全国消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+2.3%) *全国信用組合大会において植田日銀総裁講演 (内田日銀副総裁代読)	*9月の米住宅着工件数	*国庫短期証券(1264回) (3ヶ月、43,000億円、10/21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