

●資金需給

単位：億円	2024年10月18日 需給速報		2024年10月21日 需給予想		2024年10月22日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 400		▲ 400	
財政	2,900		15,500		▲ 1,000	
資金過不足	2,700		15,100		▲ 1,400	
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			11,100			
CP等買入		▲ 100		▲ 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		▲ 100		▲ 100		
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 8,500	8,600		8,500		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	2,600		34,400		▲ 1,400	
当座預金残高	5,477,100		5,511,500		5,510,100	
準備預金残高	4,903,700		10月21日以降の残り所要積立額			
積み終了先	4,898,900					
超過準備	4,879,700					
非準備預金先	573,400					
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	99.48%	日数	16.13%		

●短期金融市場関連指標

2024/10/18	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	0.227	0.227				－	0.232
T/N							－	0.239
S/N							－	－
1W	0.230	0.269	0.262				－	0.201
2W			0.280				－	0.201
3W							－	0.201
1M							－	0.202
3M							0.002	0.209
6M							0.090	0.257
1Y							0.290	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）
0.965	+0.005	38,981.75	+70.56	150.09-12	150.08-11
日付	10/10	10/11	10/15	10/16	10/17
日銀当預残	5,408,900	5,381,300	5,476,100	5,470,600	5,474,500
準備預金残	4,836,700	4,832,500	4,910,200	4,896,400	4,912,500
マネタリーベース	6,649,000	6,621,700	6,716,700	6,710,400	6,714,700
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	114,942	112,101	113,878	109,875	110,598
うち無担	74,846	72,059	74,369	70,714	72,124
うちO/N	29,016	26,769	28,889	25,134	25,534
うち有担	40,096	40,042	39,509	39,161	38,474

●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	1264	－	43,000	2024/10/21	2025/1/27	105,411	33,600.5	99.9980	0.0074%	55.7506%	99.9993	0.0026%	9,399

●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	2024/10/21			7,649	3,256	0.008		0.009	77.2
国債買入（残存期間3年超5年以下）	3,250	2024/10/21			10,150	3,257	0.012		0.014	15.3
国債買入（残存期間5年超10年以下）	3,750	2024/10/21			8,607	3,758	0.013		0.016	86.9
国債買入（残存期間25年超）	750	2024/10/21			1,607	752	0.004		0.010	37.8
社債等買入	500	2024/10/23			1,208	500	0.666		0.693	10.0
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2024/10/18	2024/10/21	▲0.050	8,730	8,730		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2024/10/18	2024/10/21	▲0.050	0	0				

●2024年10月21日の予定

*特にありません

◆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

●2024年10月18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3日積みとなった事により、邦銀業態を中心に資金調達ニーズが一段と強まる展開となったものの、レート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、0.235～0.245%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＞

18日はTB3M物（第1264回）の入札が実施され、引き続き強い結果となった。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。この他、1Y物でも少額出会いが見られた。

＜CP市場＞

CP発行市場は大型発行を含め、複数の業態で入札が実施された。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。