

●資金需給

単位：億円	2024年10月23日 需給速報		2024年10月24日 需給予想		2024年10月25日 当社予想							
銀行券	▲ 300		▲ 800		▲ 500							
財政	▲ 6,000		500		▲ 9,000							
資金過不足	▲ 6,300		▲ 300		▲ 9,500							
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		▲ 200		▲ 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	500											
気候変動対応オペ												
E T F 買入												
国債補完供給	▲ 7,200	8,700		7,200								
※ドル資金供給用国債国債供給												
当預増減	▲ 4,500		6,700		▲ 9,500							
当座預金残高	5,484,800		5,491,500		5,482,000							
準備預金残高	4,912,300		<table><tr><td colspan="2">10月24日以降の残り所要積立額</td></tr><tr><td>積数</td><td>13,300</td></tr><tr><td>1日平均</td><td>600</td></tr></table>				10月24日以降の残り所要積立額		積数	13,300	1日平均	600
10月24日以降の残り所要積立額												
積数	13,300											
1日平均	600											
積み終了先	4,910,500											
超過準備	4,910,400											
非準備預金先	572,500											
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 99.67%		日数		25.81%							

●2024年10月23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、邦銀業態を中心とした幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られ、引き続き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、0.23~0.245%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＞

23日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、特段の出会いは見られなかった。

＜CP市場＞

CP発行市場は、複数の入札が実施された。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。

●短期金融市場関連指標

2024/10/23	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				-	0.241
T/N							-	0.235
S/N							-	-
1W							-	0.203
2W							-	0.202
3W							-	0.202
1M	0.280	0.300	0.287				-	0.204
3M							0.002	0.212
6M							0.100	0.279
1Y							0.300	0.328

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)
0.975	0.000	38,104.86	▲ 307.10	151.15-16	152.35-37

日付	10/16	10/17	10/18	10/21	10/22
日銀当預残	5,470,600	5,474,500	5,477,100	5,494,500	5,489,300
準備預金残	4,896,400	4,912,500	4,903,700	4,901,600	4,901,700
マネタリーベース	6,710,400	6,714,700	6,717,400	6,735,300	6,730,500
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	109,875	110,598	114,615	111,134	111,507
うち無担	70,714	72,124	75,151	72,312	73,067
うちO/N	25,134	25,534	28,981	25,372	25,977
うち有担	39,161	38,474	39,464	38,822	38,440

●入札結果

名称	回数	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1非面 格競争入 札(億円)	非競争 入札(億 円)
交付税特会	-	-	13,000	2024/11/5	2025/5/7	65,349	12,990.02		0.325%	63.3525%		0.312%		10

●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)		2024/10/23	2024/10/24	▲0.050	7,446	7,446		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/23	2024/10/24	▲0.050	0	0				

●2024年10月24日の予定

*9月の米新築一戸建て販売件数	*20年利付国債入札 (10,000億円、10/25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