

Central Daily Market Report

2024年10月24日(木)

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24日 需給速報	2024年10月25日 需給予想	2024年10月28日 当社予想			
銀行券	▲ 800	▲ 500	1,000			
財政	3,100	3,300	10,000			
資金過不足	2,300	2,800	11,000			
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						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入		▲ 200	▲ 400			
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入			▲ 700			
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 6,100	7,200	6,100			
当預増減	3,200	7,800	11,000			
当座預金残高	5,488,000	5,495,800	5,506,800			
準備預金残高	4,919,100					
積み終了先	4,917,500			10月25日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,917,500			積数	11,700	
非準備預金先	568,900			1日平均	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	99.71%	日数	29.03%		

●2024年10月24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0.226~0.227%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、0.23~0.24%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>

24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、数件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

2024/10/24	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京レポレート
	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				-	0.239
T/N							-	0.230
S/N							-	-
1W	0.268	0.269	0.268				-	0.202
2W							-	0.203
3W							-	0.202
1M			0.295				-	0.204
3M							0.002	0.212
6M							0.100	0.276
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)
0.955	▲ 0.020	38,143.29	+38.43	152.74-77	152.12-14
日付	10/17	10/18	10/21	10/22	10/23
日銀当預残	5,474,500	5,477,100	5,494,500	5,489,300	5,484,800
準備預金残	4,912,500	4,903,700	4,901,600	4,901,700	4,912,300
マネタリーベース	6,714,700	6,717,400	6,735,300	6,730,500	6,726,200
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	110,598	114,615	111,134	111,507	110,719
うち無担	72,124	75,151	72,312	73,067	73,026
うちO/N	25,534	28,981	25,372	25,977	25,776
うち有担	38,474	39,464	38,822	38,440	37,693

●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)
20年利付国債	190	1.8%	10,000	2024/10/25	2044/9/20	23,615	7,776	99.70	1.820%	1.7316%	99.99	1.800%	2,220

●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	応募総額(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)		2024/10/24	2024/10/25	▲0.050	6,284	6,284		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/24	2024/10/25	▲0.050	0	0				

●2024年10月25日の予定

*10月の都区部消費者物価指数(CPI) (市場予想:前年同月比(除く生鮮)+1.7%)	*9月の米耐久財新規受注	*国庫短期証券(1265回)入札 (3ヶ月、43,000億円、10/28発行)
*9月の企業向けサービス価格指数		
*8月の景気動向指数改訂状況		

◆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