

Central Daily Market Report

2024年10月28日(月)

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28日 需給速報	2024年10月29日 需給予想	2024年10月30日 当社予想	
銀行券		▲ 100	0	▲ 400	
財政		1,800	▲ 4,600	1,800	
資金過不足		1,700	▲ 4,600	1,400	
金融調節		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			8,900		
CP等買入		▲ 700		▲ 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		▲ 600			
気候変動対応オペ					
E T F 買入					
国債補完供給		▲ 6,600	6,700	6,600	
※ F D L資金供給用国債国債供給					
当預増減		500	10,700	▲ 6,600	
当座預金残高		5,488,000	5,498,700	5,492,100	
準備預金残高		4,922,300			
積み終了先		4,921,400		10月29日以降の残り所要積立額	
超過準備		4,921,200		積数 6,100	
非準備預金先		565,700		1日平均 300	
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	99.85%	日数 41.94%	

●短期金融市場関連指標

2024/10/28	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	0.275	0.228				-	0.240
T/N							-	0.236
S/N							-	-
1W							-	0.204
2W			0.227				-	0.203
3W							-	0.203
1M							-	0.206
3M	0.320	0.330	0.325				0.020	0.213
6M							0.109	0.278
1Y							0.315	0.330

●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	案分率	募入 平均価格	募入 平均利回	第1非価格 競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●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3年超5年以下)	3,250	2024/10/29			9,781	3,254	0.004		0.005	55.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/10/29			8,900	3,757	0.015		0.017	15.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/10/29			3,498	1,504	0.027		0.030	78.7
国債買入(物価連動債)	600	2024/10/29			1,870	600	▲0.160		▲0.217	86.7
CP等買入	4,000	2024/10/31			8,130	4,000	0.345		0.370	26.9
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/10/28	2024/10/29	▲0.050	6,714	6,714		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/28	2024/10/29	▲0.050	50	50		▲0.050	▲0.050	

●2024年10月29日の予定

*月例経済報告	*8月のS&P/ケース・シャー住宅価格指数	*2年利付国債入札 (26,000億円、11/1発行)
*9月の完全失業率(市場予想:2.5%)	*10月の米CB消費者信頼感指数	
*9月の有効求人倍率(市場予想:1.23倍)		

◆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28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、引き続き邦銀勢からの旺盛な資金調達ニーズを背景に、概ね0.227%程度で推移した。
ターム物は目立った出会いがなく閑散であった。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.20~0.245%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>

28日のアウトライイト市場は動意なく閑散な中、1Y物と6M物で少額の出合いが見られた。

<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。

CP等買入オペが事前予定通り4,000億円でオファーされた。結果は、按分レート0.345%、平均レート0.370%と、前回(按分0.270%、平均0.334%)比で、按分、平均ともに上昇した。

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)
0.970	+0.025	38,605.53	+691.61	152.95~97	153.33~35

日付	10/21	10/22	10/23	10/24	10/25
日銀当預残	5,494,500	5,489,300	5,484,800	5,488,000	5,487,500
準備預金残	4,901,600	4,901,700	4,912,300	4,919,100	4,914,200
マネタリーベース	6,735,300	6,730,500	6,726,200	6,730,300	6,730,200
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	111,134	111,507	110,719	111,431	112,444
うち無担	72,312	73,067	73,026	73,201	75,127
うちO/N	25,372	25,977	25,776	25,801	27,052
うち有担	38,822	38,440	37,693	38,230	37,317