

# Central Daily Market Report

2024年10月29日(火)

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29日 需給速報	2024年10月30日 需給予想	2024年10月31日 当社予想
銀行券	▲ 100	▲ 300	▲ 1,000
財政	▲ 6,900	▲ 900	▲ 1,000
資金過不足	▲ 7,000	▲ 1,200	▲ 2,000

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			8,000	▲ 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		▲ 200			4,000	
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 8,800	6,600		8,800		
※ドル資金供給用担保提供供給						
当預増減	▲ 500		7,600		2,000	

当座預金残高	5,487,500	5,495,100	5,497,100	
準備預金残高	4,908,800			
積み終了先	4,908,300			
超過準備	4,908,300			
非準備預金先	578,700			
10月30日以降の残り所要積立額				
積数		5,500		
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	99.86%	日数	45.16%

## ●短期金融市場関連指標

2024/10/29	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
O/N	0.220	0.275	0.228				-	0.137
T/N			0.213				-	0.183
S/N							-	-
1W	0.231	0.390	0.288				-	0.203
2W			0.290				-	0.203
3W							-	0.203
1M							-	0.205
3M			0.350				0.023	0.213
6M							0.115	0.276
1Y							0.315	0.330

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	0.000	38,903.68	+298.15	153.13-16	153.16-18
日付	10/22	10/23	10/24	10/25	10/28
日銀当預残	5,489,300	5,484,800	5,488,000	5,487,500	5,488,000
準備預金残	4,901,700	4,912,300	4,919,100	4,914,200	4,922,300
マネタリーベース	6,730,500	6,726,200	6,730,300	6,730,200	6,730,900
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%	0.228%
コール市場残高	111,507	110,719	111,431	112,444	112,695
うち無担	73,067	73,026	73,201	75,127	76,044
うちO/N	25,977	25,776	25,801	27,052	28,249
うち有担	38,440	37,693	38,230	37,317	36,651

## ●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・利回差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回差	第I非価格競争入札(億円)
2年利付国債	466	0.5%	26,000	2024/11/1	2026/11/1	98,978	20,308	100.085	0.457%	98.6111%	100.090	0.454%	5,686

## ●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・利回差・価格差	全取レート・利回差・価格差	平均落札レート・利回差・価格差	按分比率
米ドル資金供給		2024/10/31	2024/11/7	5.080	1	1				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/10/29	2024/10/30	▲0.050	9,000	9,000		▲0.050	▲0.050	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利方式〉	8,000	2024/10/30	2024/11/13	0.250	13,232	8,007				60.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/29	2024/10/30	▲0.050	1	1		▲0.050	▲0.050	

## ●2024年10月30日の予定

*日銀金融政策決定会合(1日目、31日まで)	*7-9月期の米GDP速報値
*10月の消費動向調査	*7-9月期のユーロ圏GDP1次速報

◆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場合があります。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