

Central Daily Market Report

2024年10月31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31日 需給速報	2024年11月1日 需給予想	2024年11月5日 当社予想
銀行券	▲ 200	200	1,500
財政	▲ 5,100	▲ 22,300	2,000
資金過不足	▲ 5,300	▲ 22,100	3,500

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	4,000	▲ 700		▲ 100		
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	▲ 7,900	9,300		7,900		

当預増減	▲ 600	▲ 14,300	3,500	
当座預金残高	5,483,600	5,469,300	5,472,800	
準備預金残高	4,912,500			
積み終了先	4,912,100			
超過準備	4,912,100			
非準備預金先	571,100			
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	99.89%	日数	51.61%

●2024年10月31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合いがなく閑散であった。

また、日銀金融政策決定会合において政策金利の現状維持が決定された事から、コール市場では結果公表後も特段大きな影響は見られなかった。

<レボ市場>

GC T/Nは、0.18~0.25%程度での出合いとなった。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>

31日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で少額の出合いが見られた。

<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

2024/10/31	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	0.295	0.227				-	0.178
T/N							-	0.234
S/N							-	-
1W							-	0.201
2W	0.295	0.400	0.330				-	0.201
3W							-	0.201
1M	0.285	0.330	0.296				-	0.202
3M			0.325				0.020	0.213
6M							0.125	0.278
1Y							0.310	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)
0.935	▲ 0.015	39,081.25	▲ 196.14	153.23-25	152.24-26
日付	10/24	10/25	10/28	10/29	10/30
日銀当預残	5,488,000	5,487,500	5,488,000	5,487,500	5,484,200
準備預金残	4,919,100	4,914,200	4,922,300	4,908,800	4,906,800
マネタリーベース	6,730,300	6,730,200	6,730,900	6,730,400	6,727,400
無担O/N加重平均	0.227%	0.227%	0.228%	0.228%	0.227%
コール市場残高	111,431	112,444	112,695	114,543	114,607
うち無担	73,201	75,127	76,044	77,574	78,109
うちO/N	25,801	27,052	28,249	29,609	29,844
うち有担	38,230	37,317	36,651	36,969	36,498

●入札結果

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
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/10/31	2024/11/1	▲0.150	8,109	8,109		▲0.150	▲0.150	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/31	2024/11/1	▲0.150	0	0				

●日銀 金融政策決定会合・結果

●当面の金融政策運営について

日本銀行は、本日、政策委員会・金融政策決定会合において、次回金融政策決定会合までの金融市場調節方針を、以下のとおりとすることを決定した(全員一致)。
無担保コールレート(オーバーナイト物)を、0.25%程度で推移するよう促す。

●2024年11月1日の予定

*10月の米雇用統計	*9月の米建設支出	*国庫短期証券(1266回)入札
*10月のISM製造業景況指数		(3ヶ月、43,000億円、11/5発行)

◆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