

Central Daily Market Report

2024年10月7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7日 需給速報	2024年10月8日 需給予想	2024年10月9日 当社予想
銀行券	400	100	1,000
財政	2,200	▲ 4,500	▲ 6,000
資金過不足	2,600	▲ 4,400	▲ 5,000

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	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			11,700					
CP等買入				▲ 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								
気候変動対応オペ								
E T F買入								
国債補完供給	▲ 11,100	11,200		11,100				
当増減	2,700		18,200		▲ 5,000			

当座預金残高	5,403,200	5,421,400	5,416,400	
準備預金残高	4,840,700			
積み終了先	4,840,700			
超過準備	4,840,700			
非準備預金先	562,500			
積み期間(9/16~10/15)の所要準備額			3,924,400	
準備預金進捗率	実績	99.99%	日数	73.33%

●2024年10月7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、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られており、出会い水準は0.225~0.227%程度と横ばい圏で推移した。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、0.22~0.235%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>

7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、複数の業態から発行が実施され、一部で大型発行も見られた。発行レートは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

2024/10/7	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	売買参考値	平均値
O/N	0.220	0.227	0.227				-	0.233
T/N							-	0.233
S/N							-	-
1W			0.226				-	0.201
2W	0.227	0.280	0.232				-	0.200
3W							-	0.200
1M							-	0.201
3M	0.330	0.350	0.343				▲ 0.005	0.209
6M							0.090	0.251
1Y							0.200	0.317

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)
0.920	+0.040	39,332.74	+697.12	148.78-80	148.27-29
日付	9/30	10/1	10/2	10/3	10/4
日銀当預残	5,494,300	5,465,600	5,415,600	5,426,700	5,400,500
準備預金残	4,951,000	4,936,800	4,859,900	4,870,200	4,843,900
マネタリーベース	6,734,600	6,706,500	6,656,100	6,667,600	6,640,900
無担O/N加重平均	0.225%	0.227%	0.227%	0.227%	0.227%
コール市場残高	106,923	110,691	113,250	109,236	112,016
うち無担	68,331	69,311	71,329	70,061	74,258
うちO/N	30,501	28,631	29,174	26,686	30,993
うち有担	38,592	41,380	41,921	39,175	37,758

●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1年超3年以下)	3,250	2024/10/8			11,128	3,256	0.021		0.022	7.5
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2024/10/8			13,375	3,252	0.029		0.032	18.4
国債買入(残存期間5年超10年以下)	3,750	2024/10/8			9,127	3,758	0.027		0.029	84.0
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,500	2024/10/8			2,955	1,503	0.035		0.040	20.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2024/10/7	2024/10/8	▲0.050	11,424	11,424		▲0.050	▲0.050	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2024/10/7	2024/10/8	▲0.050	4	4		▲0.050	▲0.050	

●2024年10月8日の予定

*8月の全世帯家計調査(市場予想:消費支出、前年比▲2.6%)	*8月の米貿易収支	*30年利付国債入札(9,000億円、10/9発行)
*8月の毎月勤労統計調査速報		
*8月の国際収支	*9月の景気ウォッチャー調査	

◆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